

공시일	2019-11-13
기준일	2019-11-12

## 포커스농산물모(채권-파생형)

### 1. 계약금액

(단위:USD 백만)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	5	0	5	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

\* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

### 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

\* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음



4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

84

공시일	2019-11-13
기준일	2019-11-12

## SMART합성-MSCI선진국증권상장

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	14,341	0	14,341	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWMXWO0( 신한MXWO 미래S190822

1,216

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

### 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

702

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-11-13
기준일	2019-11-12

## SMART중국본토중소형CSI500상장

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	6,772	0	6,772	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 신한CSI500미래S190910(1)	378
SWCSI50000 신한CSI500미래S190910(2)	138

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

### 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

755
-----

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-11-13
기준일	2019-11-12

## 유로인덱스모(주식-파생형)

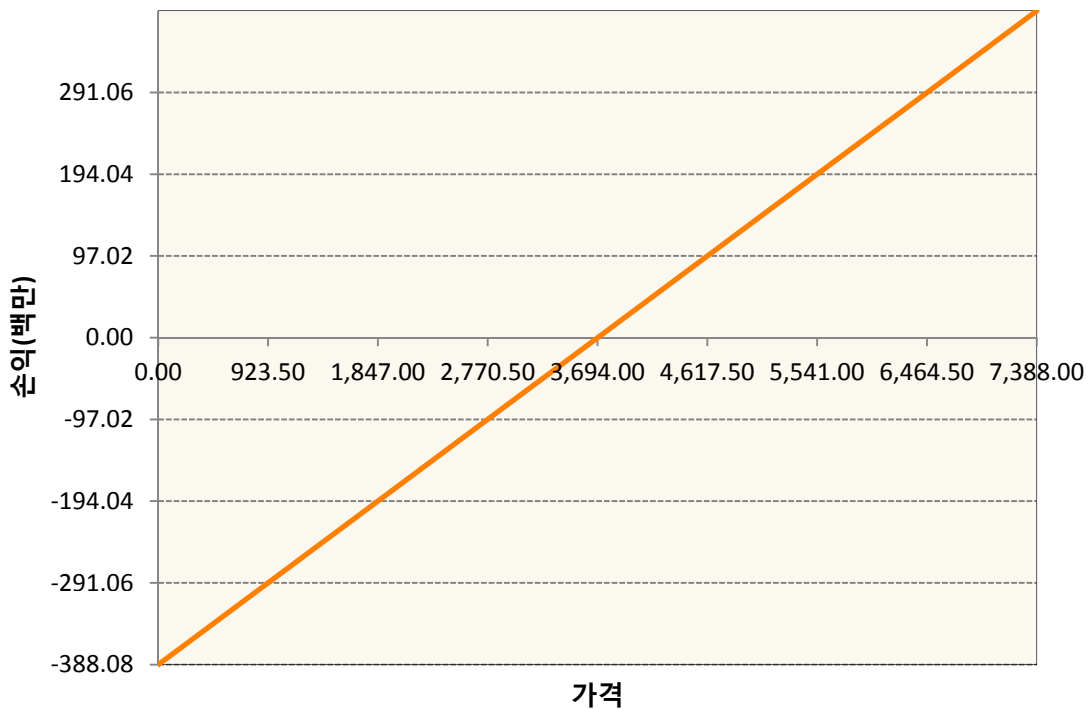
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	388	0	388	

### 2. 만기시점의 손익구조

VGZ9-EURO STOXX 50 Dec19



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGZ9	EURO STOXX 50 Dec19	31
------	---------------------	----

### 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

22

공시일	2019-11-13
기준일	2019-11-12

## 차이나인덱스모(주식-파생형)

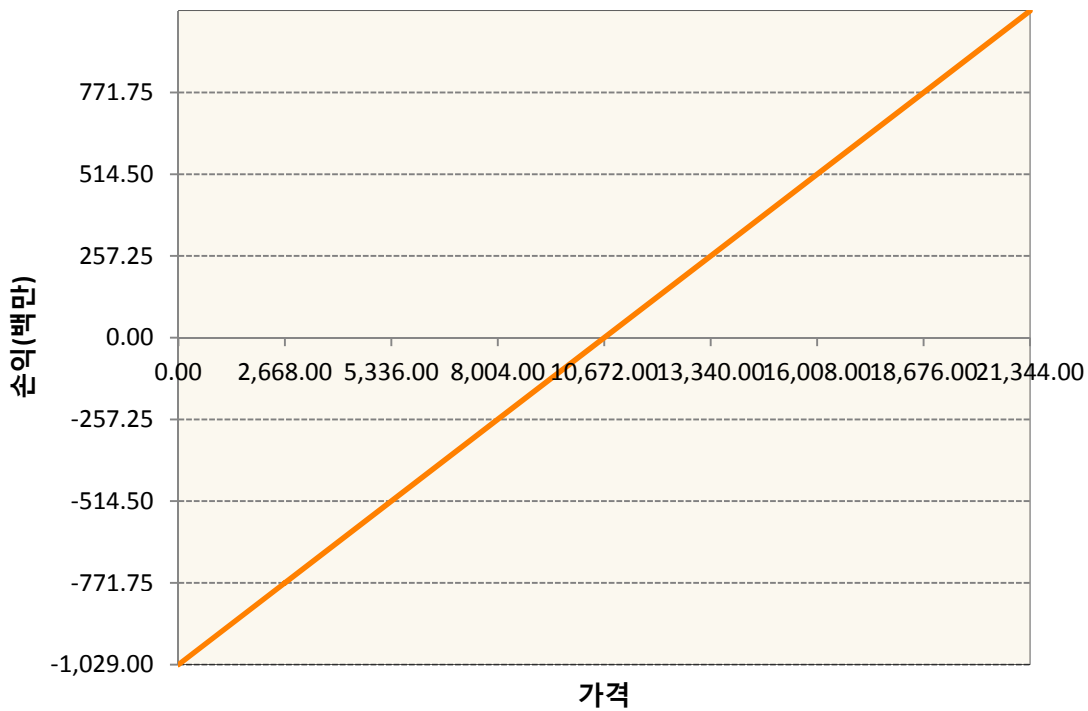
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,029	0	1,029	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

HCX9-HSCEI Futures Nov19



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCX9	HSCEI Futures Nov19	82
------	---------------------	----

### 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

74
----

공시일	2019-11-13
기준일	2019-11-12

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

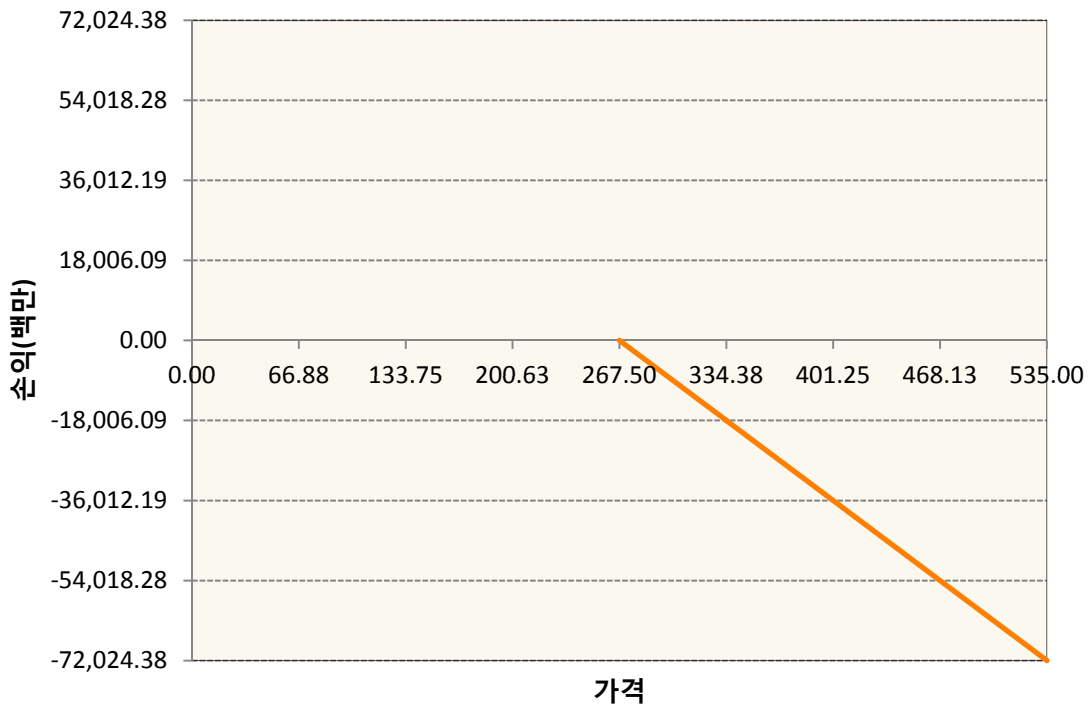
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

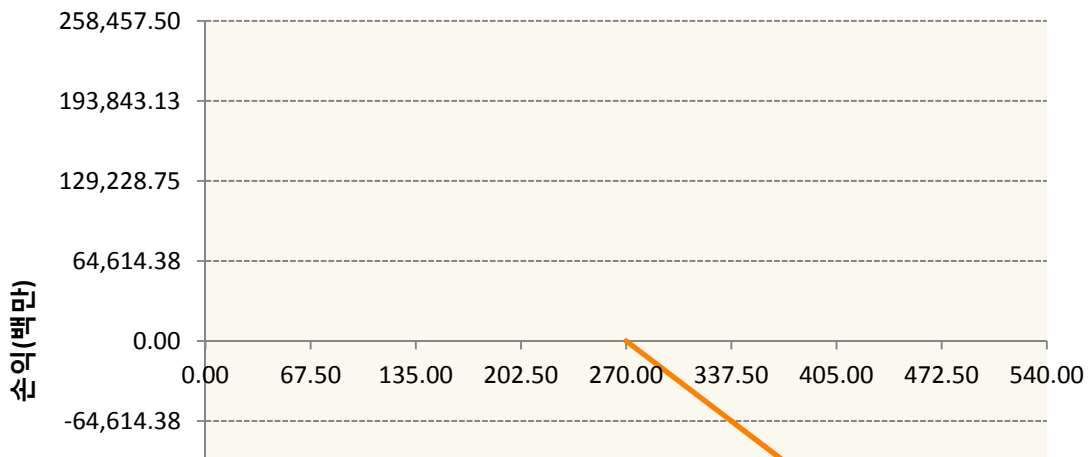
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	482,288	-482,288	장내

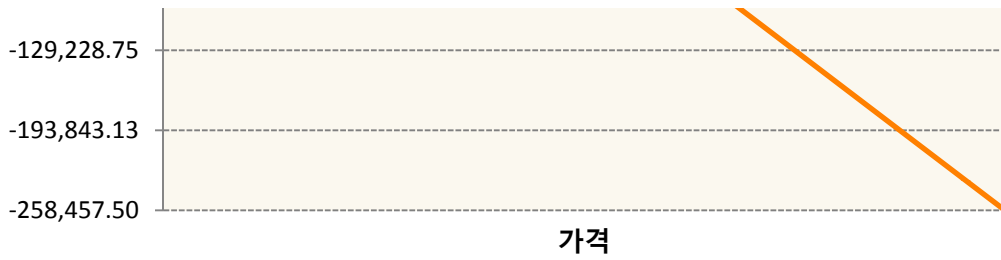
### 2. 만기시점의 손익구조

**KR4201PB2677-2019-11 콜267.5**

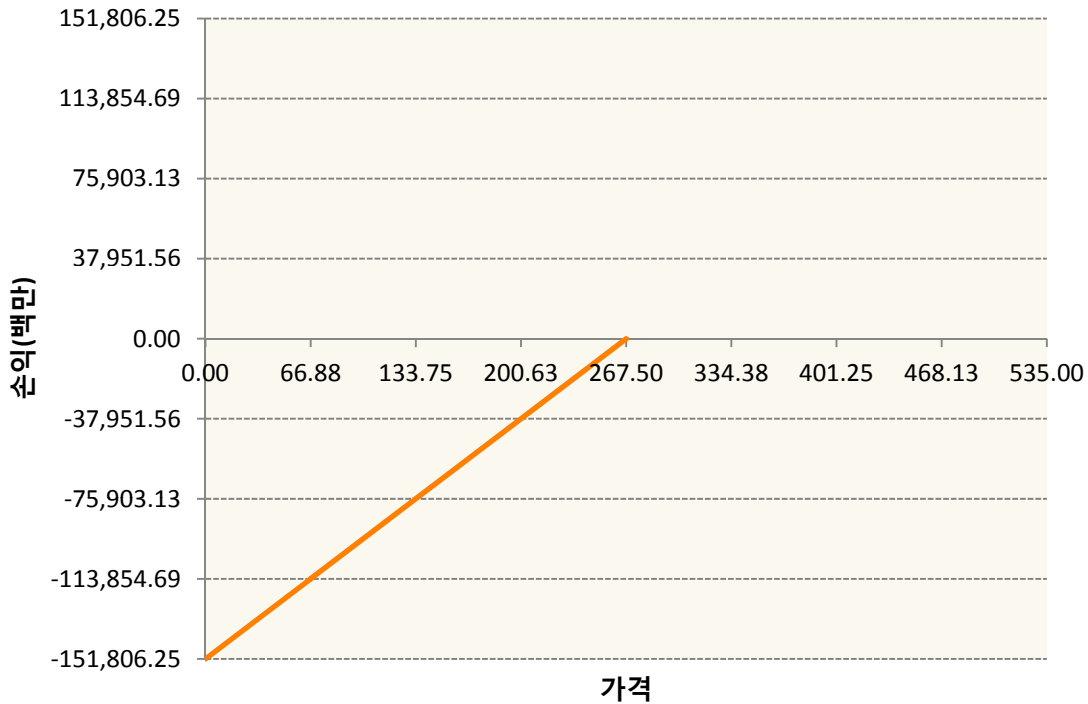


**KR4201PB2701-2019-11 콜270**





KR4301PB2676-2019-11 풋267.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201PB2677		2019-11 콜267.5					6,108	
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	4,321	4,307	4,288	4,267	4,243	4,216	4,187	
-5.33%	3,757	3,709	3,662	3,614	3,566	3,518	3,469	
-2.67%	2,029	2,022	2,012	1,998	1,982	1,963	1,941	
0%	1	1	1	0	-1	-3	-6	
2.67%	-2,035	-2,035	-2,035	-2,035	-2,035	-2,036	-2,036	
5.33%	-4,072	-4,072	-4,072	-4,072	-4,072	-4,072	-4,072	
8.00%	-6,108	-6,108	-6,108	-6,108	-6,108	-6,108	-6,108	
KR4201PB2701		2019-11 콜270					21,705	
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	13,048	13,030	13,003	12,966	12,918	12,862	12,796	

-5.33%	12,108	11,944	11,778	11,610	11,442	11,273	11,103
-2.67%	7,125	7,057	6,976	6,884	6,782	6,672	6,554
0%	13	11	7	0	-12	-30	-54
2.67%	-7,226	-7,226	-7,226	-7,226	-7,226	-7,227	-7,229
5.33%	-14,466	-14,466	-14,466	-14,466	-14,466	-14,466	-14,466
8.00%	-21,705	-21,705	-21,705	-21,705	-21,705	-21,705	-21,705
KR4301PB2676                      2019-11 풋267.5							3,735
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-3,720	-3,720	-3,721	-3,723	-3,725	-3,729	-3,735
-5.33%	-220	-265	-310	-356	-403	-450	-498
-2.67%	0	0	0	0	-1	-2	-3
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	0	0	0	0	0	0	0
5.33%	0	0	0	0	0	0	0
8.00%	0	0	0	0	0	0	0

**4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)**

(단위:백만원)

**28,988**

공시일	2019-11-13
기준일	2019-11-12

## 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

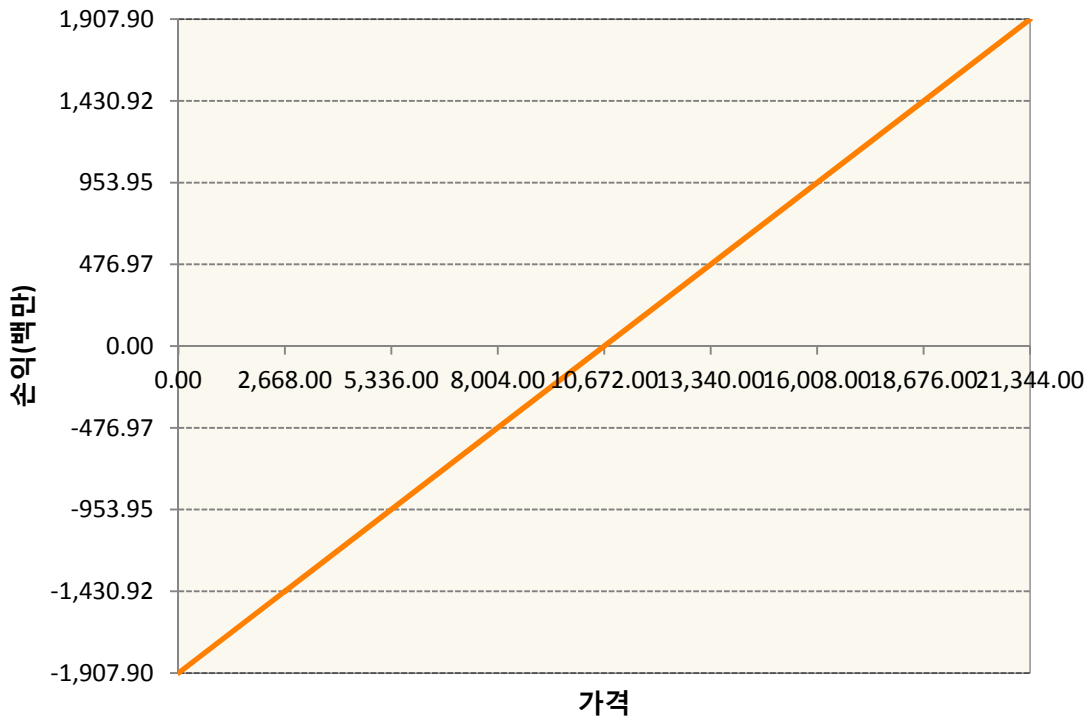
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

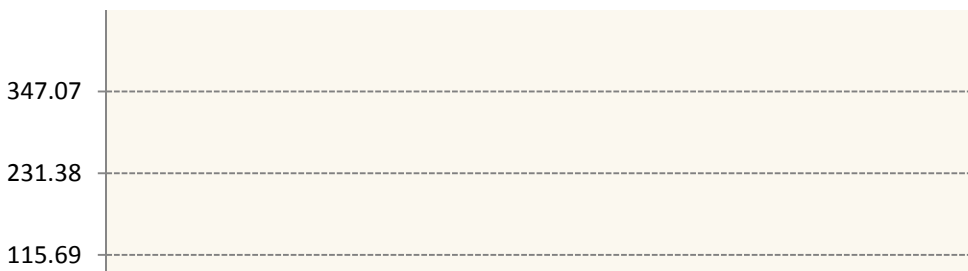
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,908	0	1,908	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,975	-4,975	장내
누계	통화	선도	667	2,756	-2,088	장외

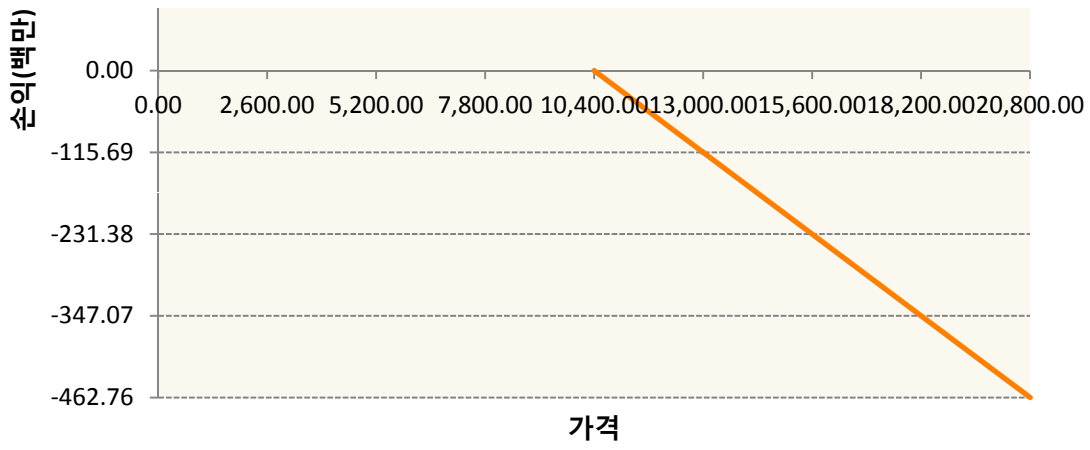
### 2. 만기시점의 손익구조

HCX9-HSCEI Futures Nov19

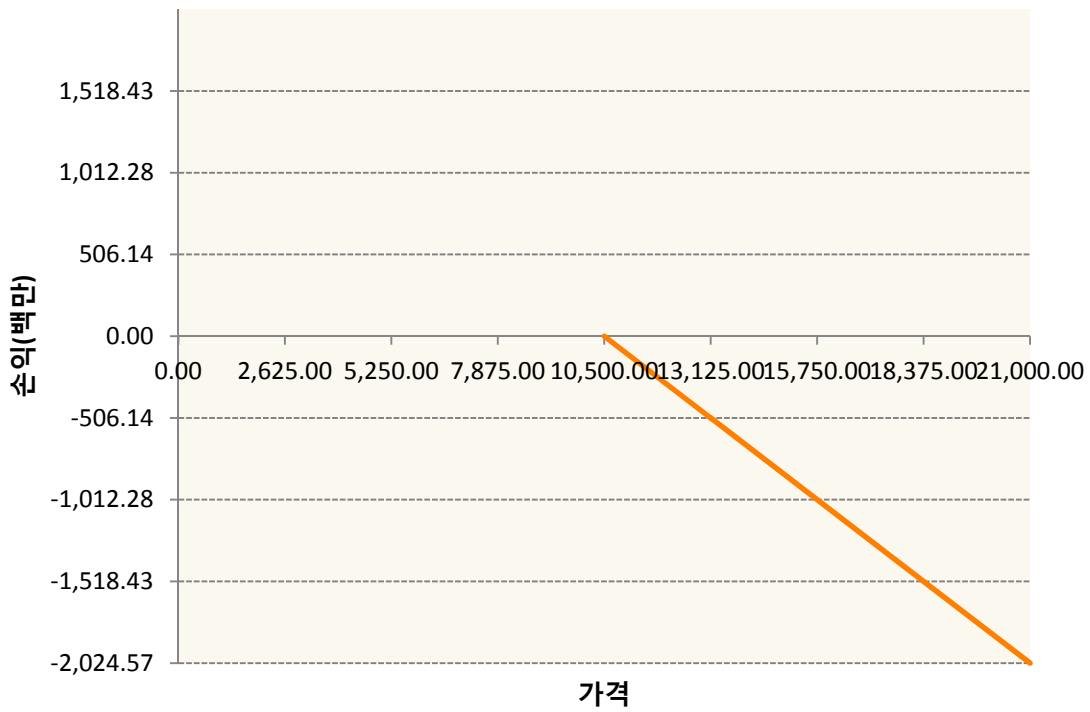


OHHIX9-C104-HSCEI

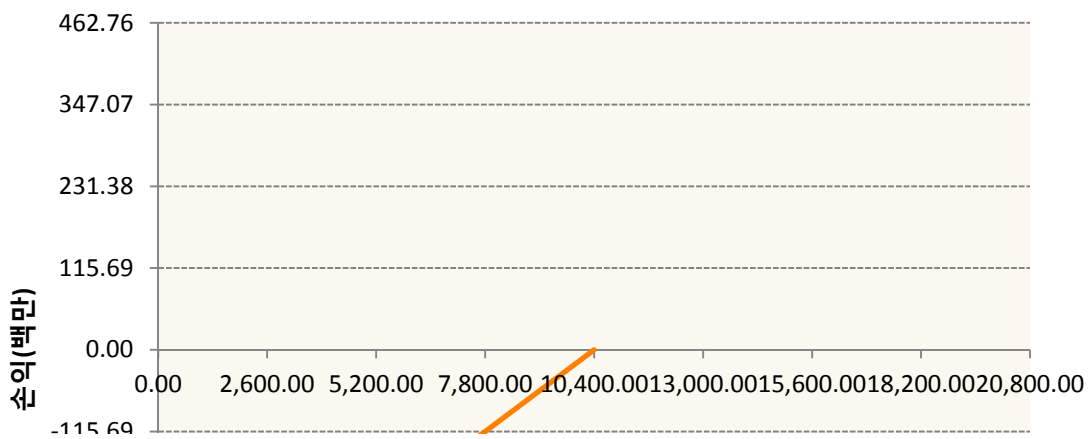


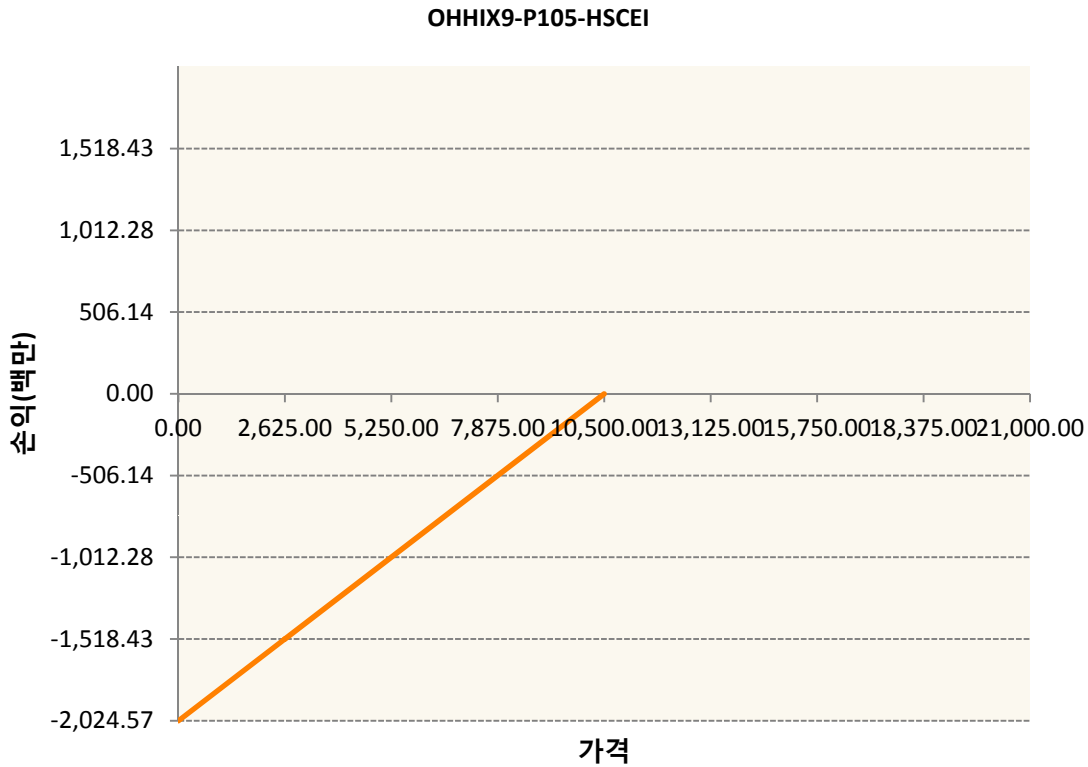
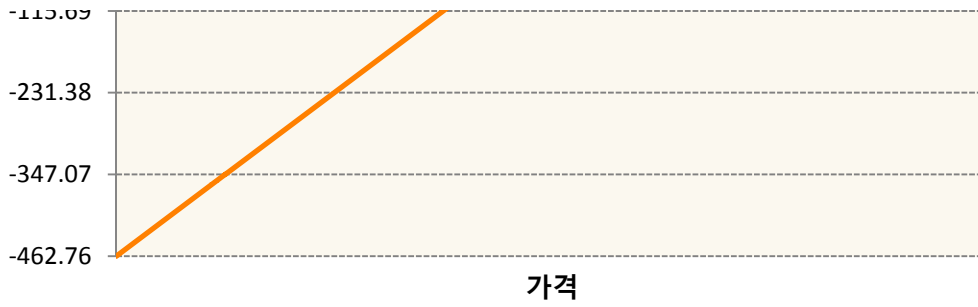


OHHIX9-C105-HSCEI



OHHIX9-P104-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
FX21019Q03 KRW/HKD 22-11-19E	220
FX21019U00 HKD/KRW 22-11-19E	6
FX21019U02 HKD/KRW 22-11-19E	47
HGX9 HSCEI Futures Nov19	153
OHHIX9-C1C HSCEI	37
OHHIX9-C1C HSCEI	162
OHHIX9-P10 HSCEI	37
OHHIX9-P10 HSCEI	162

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	578

공시일	2019-11-13
기준일	2019-11-12

## 코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

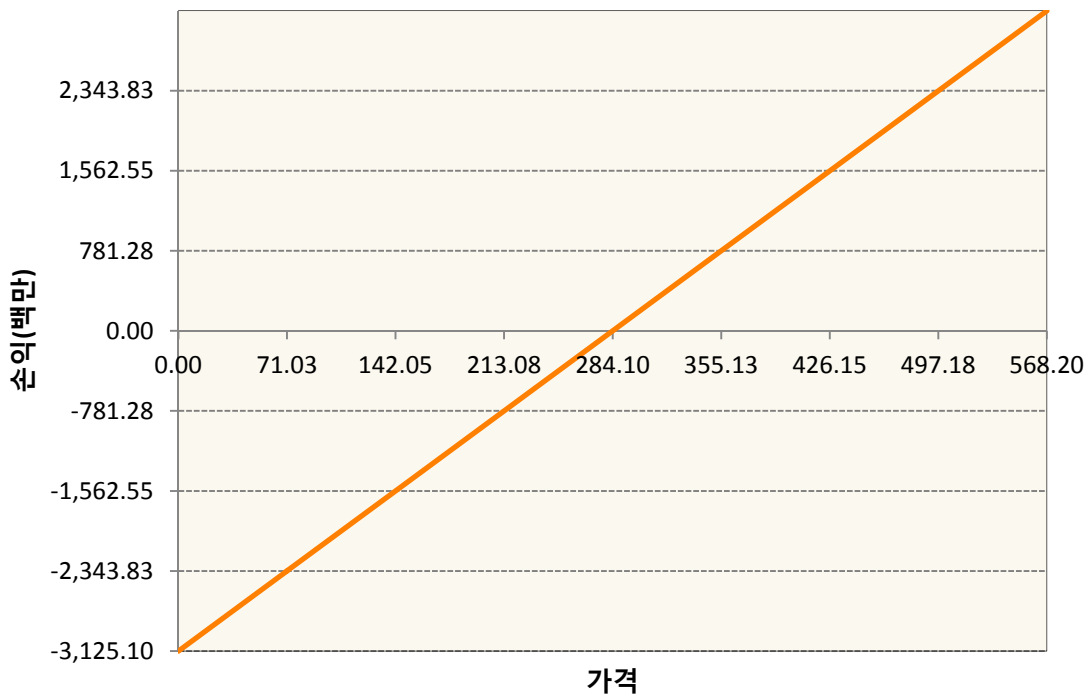
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

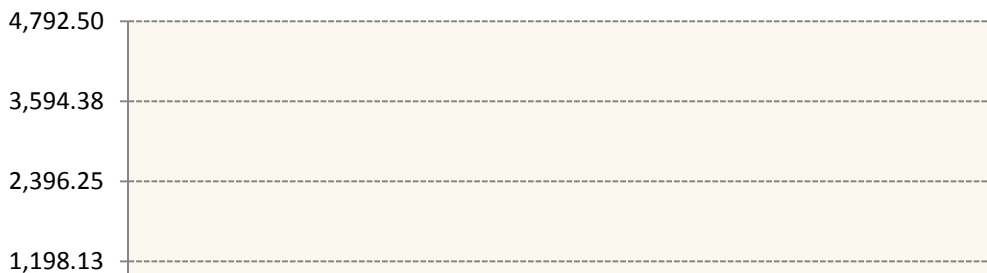
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,125	0	3,125	장내
누계	유가증권	스왑	10,625	0	10,625	장외
누계	유가증권	옵션	0	9,476	-9,476	장내

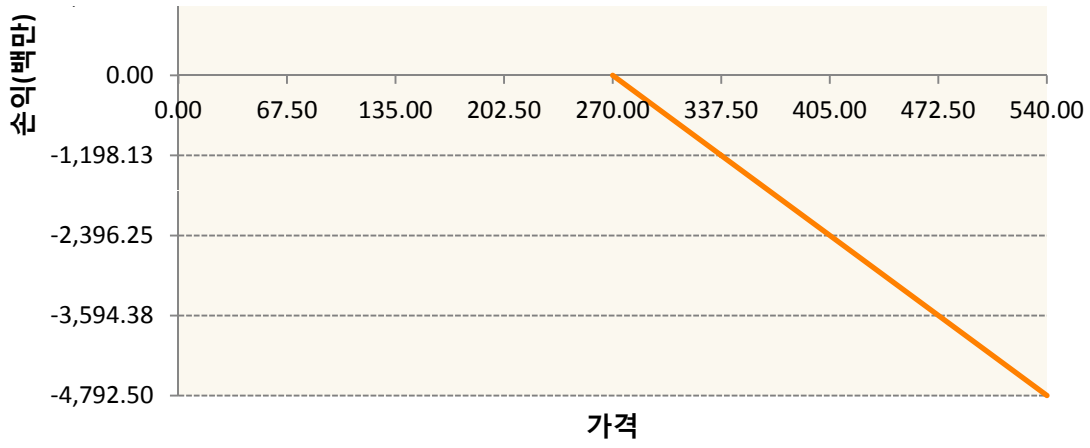
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

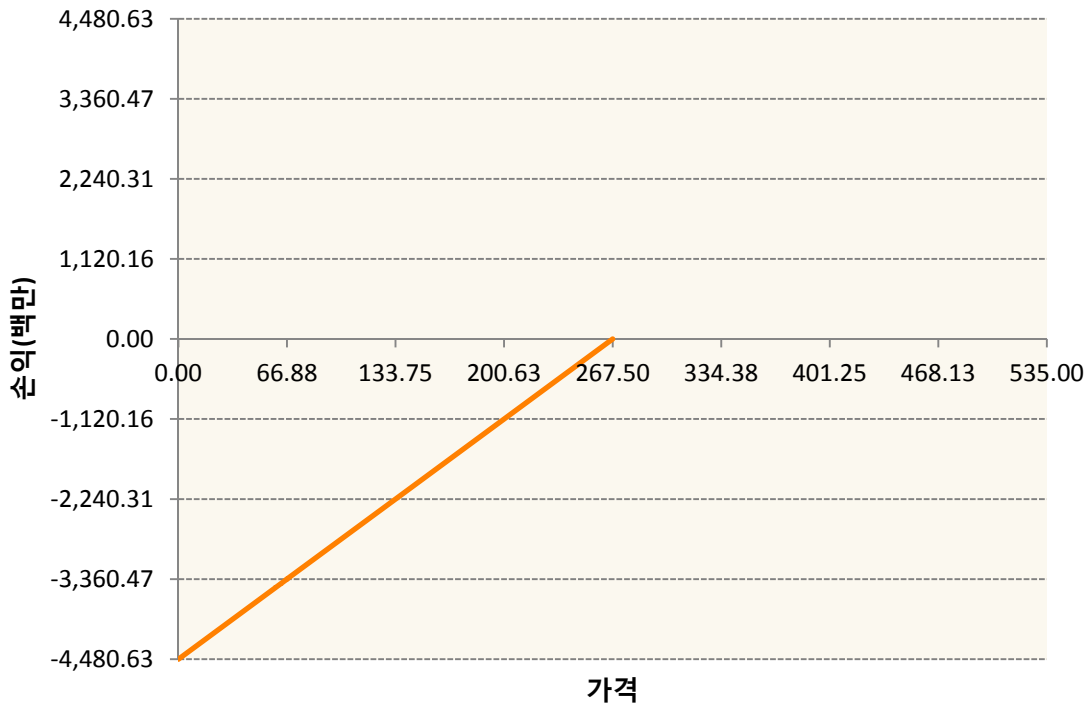


KR4201PB2701-2019-11 콜270

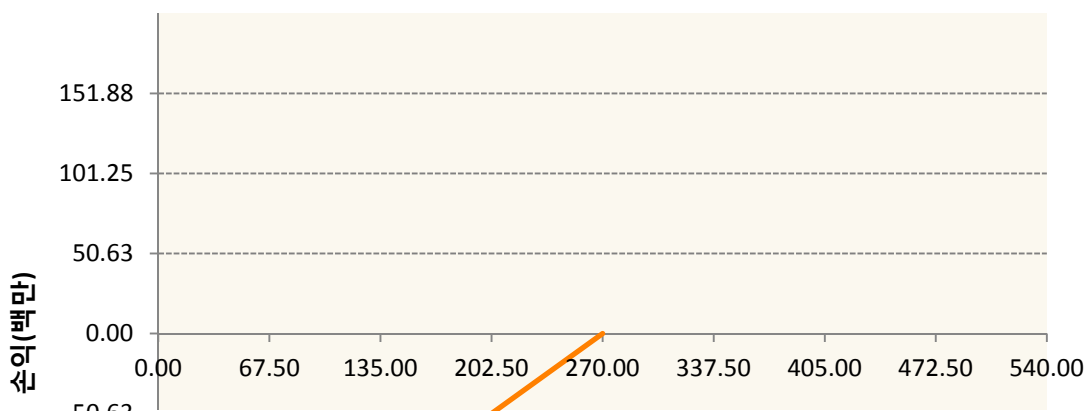




KR4301PB2676-2019-11 풋267.5



KR4301PB2700-2019-11 풋270





**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)** (단위:백만원)

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_16						908
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-908	-908	-908	-908	-908	-908	-908	
-5.33%	-606	-606	-606	-606	-606	-606	-606	
-2.67%	-303	-303	-303	-303	-303	-303	-303	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	303	303	303	303	303	303	303	
5.33%	606	606	606	606	606	606	606	
8.00%	908	908	908	908	908	908	908	
KR4101PC0002		2019-12 코스피200지수선물						250
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-250	-250	-250	-250	-250	-250	-250	
-5.33%	-166	-166	-166	-166	-166	-166	-166	
-2.67%	-83	-83	-83	-83	-83	-83	-83	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	83	83	83	83	83	83	83	
5.33%	166	166	166	166	166	166	166	
8.00%	250	250	250	250	250	250	250	
KR4201PB2701		2019-11 콜270						402
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	242	242	241	240	240	238	237	
-5.33%	225	221	218	215	212	209	206	
-2.67%	132	131	129	128	126	124	122	
0%	0	0	0	0	0	-1	-1	
2.67%	-134	-134	-134	-134	-134	-134	-134	
5.33%	-268	-268	-268	-268	-268	-268	-268	
8.00%	-402	-402	-402	-402	-402	-402	-402	
KR4301PB2676		2019-11 풋267.5						110
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	-110	-110	-110	-110	-110	-110	-110
-5.33%	-7	-8	-9	-11	-12	-13	-15
-2.67%	0	0	0	0	0	0	0
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	0	0	0	0	0	0	0
5.33%	0	0	0	0	0	0	0
8.00%	0	0	0	0	0	0	0
KR4301PB2700                      2019-11 풋270							7
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-7	-7	-7	-7	-7	-7	-7
-5.33%	-1	-1	-1	-1	-2	-2	-2
-2.67%	0	0	0	0	0	0	0
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	0	0	0	0	0	0	0
5.33%	0	0	0	0	0	0	0
8.00%	0	0	0	0	0	0	0

**4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)**

(단위:백만원)

**1,525**

공시일	2019-11-13
기준일	2019-11-12

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

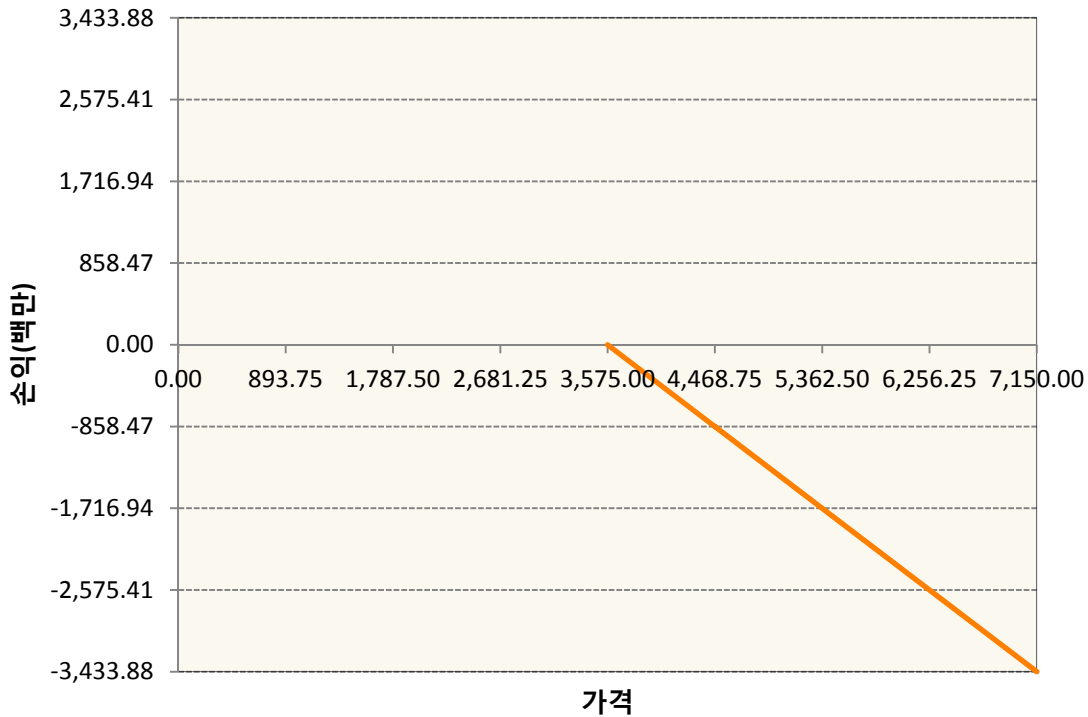
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

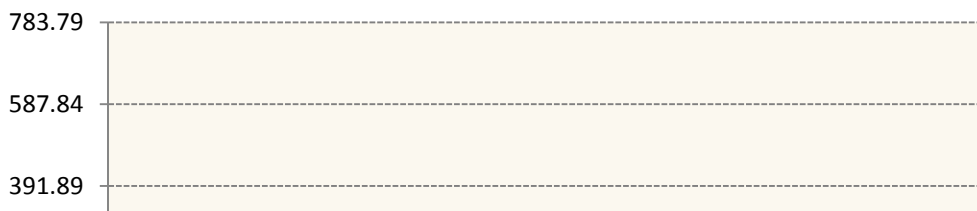
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,391	0	1,391	
누계	유가증권	스왑	20,122	0	20,122	장외
누계	유가증권	옵션	0	8,435	-8,435	장내
누계	통화	선도	2,018	6,019	-4,001	장외

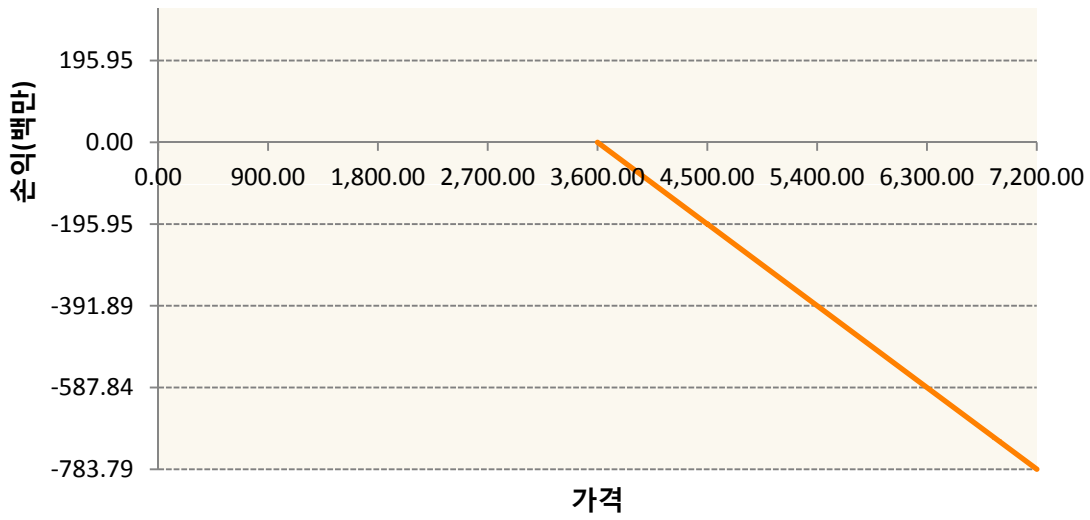
### 2. 만기시점의 손익구조

**OESXX9-C3575-EURO STOXX 50**

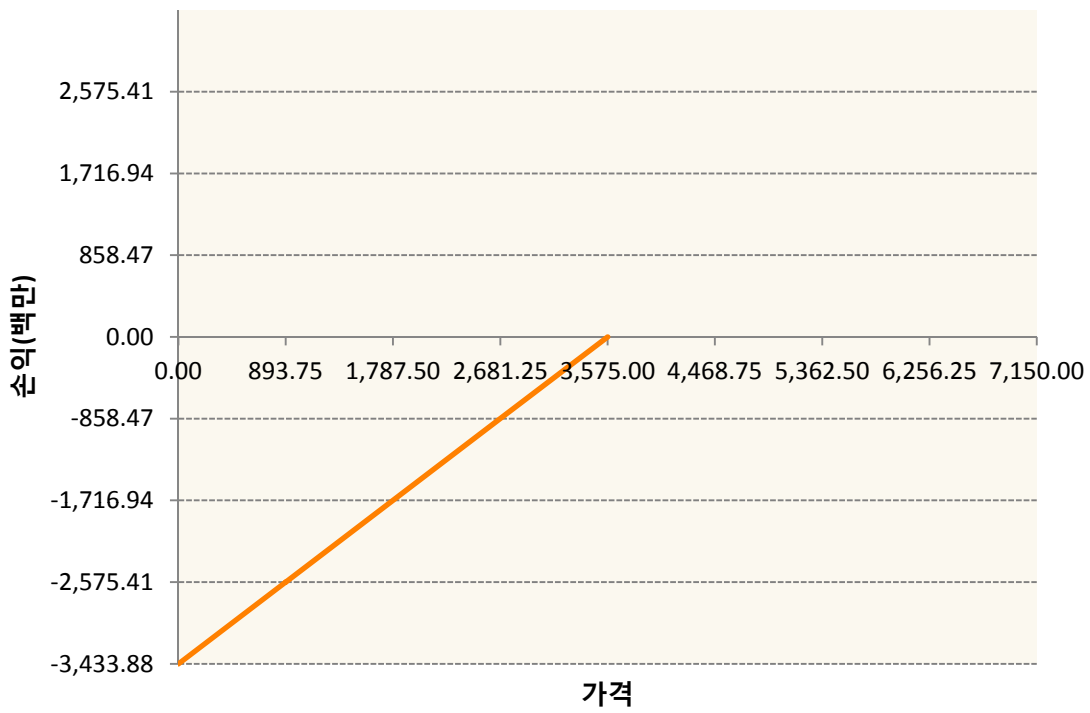


**OESXX9-C3600-EURO STOXX 50**

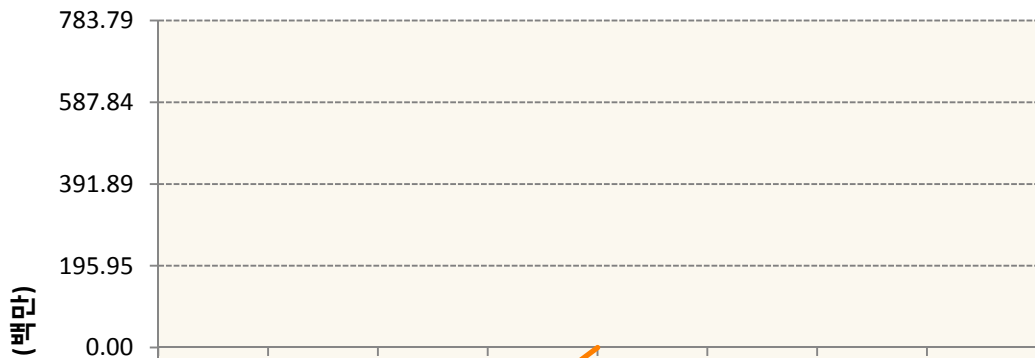


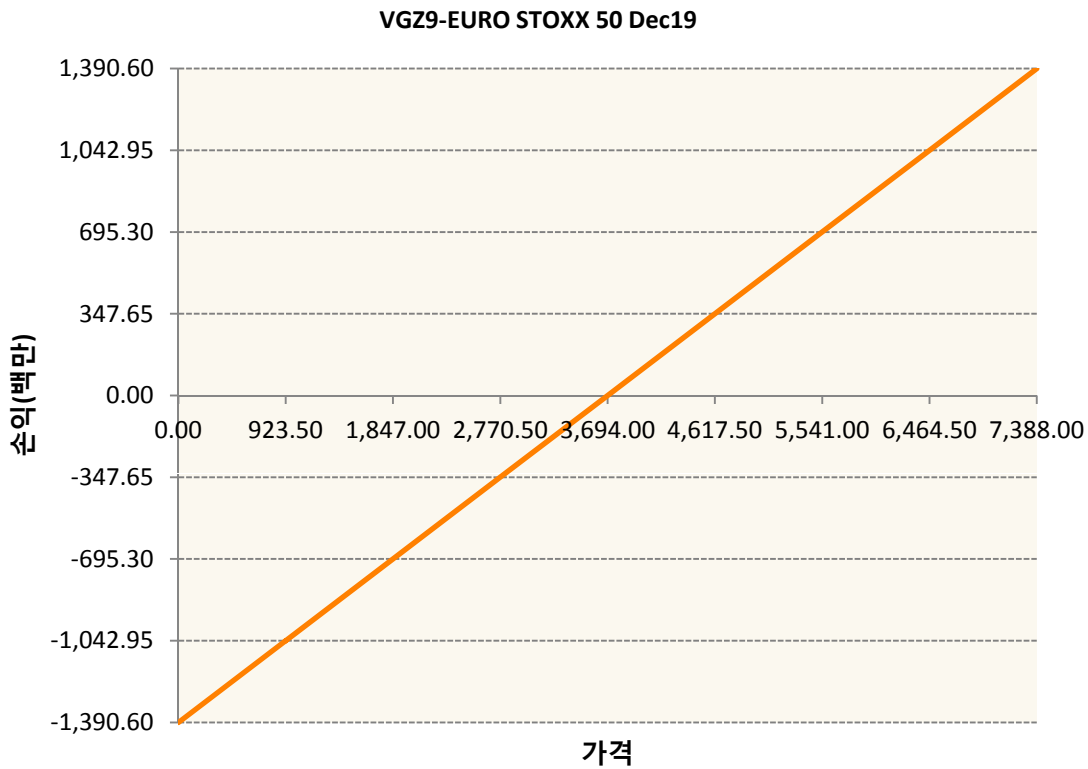
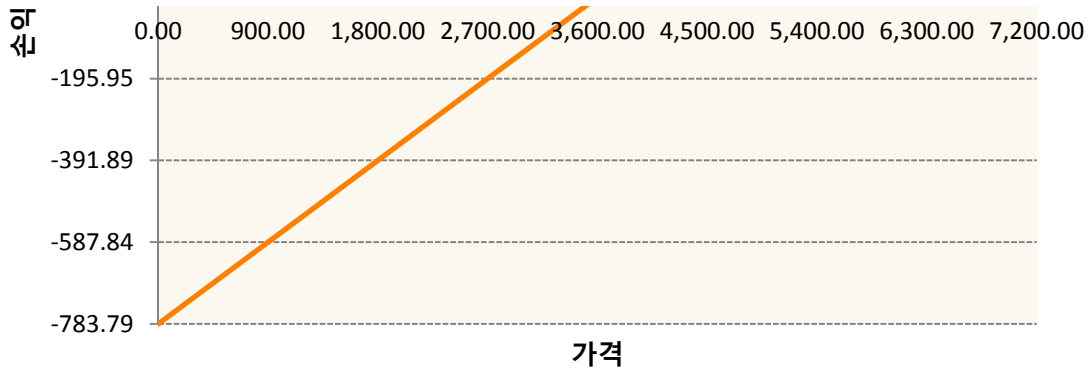


OESXX9-P3575-EURO STOXX 50



OESXX9-P3600-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY		24
FX21019U04 KRW/EUR 27-12-19E		482
FX21019V04 EUR/KRW 27-12-19E		161
OESXX9-C35 EURO STOXX 50		275
OESXX9-C36 EURO STOXX 50		63
OESXX9-P35 EURO STOXX 50		275
OESXX9-P36 EURO STOXX 50		63
VGZ9	EURO STOXX 50 Dec19	111

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

863



4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

913



4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

80



4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

124

공시일	2019-11-13
기준일	2019-11-12

## 스마트KRX300인덱스목표전환형1호

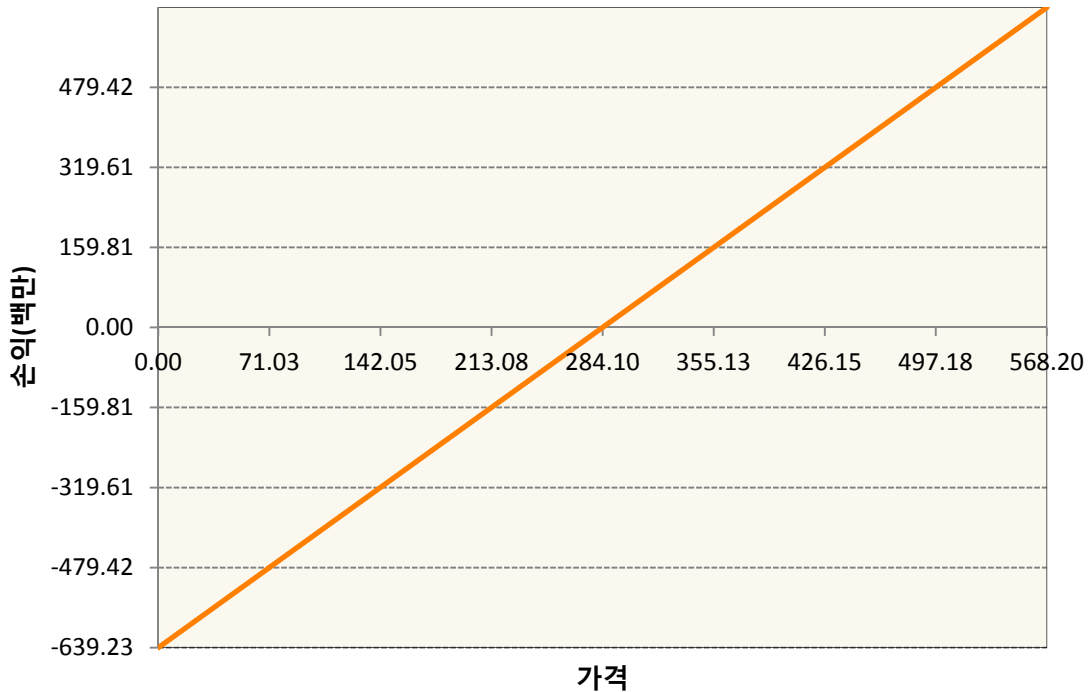
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	639	0	639	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101PC0002		2019-12 코스피200지수선물						51
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-51	-51	-51	-51	-51	-51	-51	
-5.33%	-34	-34	-34	-34	-34	-34	-34	
-2.67%	-17	-17	-17	-17	-17	-17	-17	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	17	17	17	17	17	17	17	
5.33%	34	34	34	34	34	34	34	
8.00%	51	51	51	51	51	51	51	

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

40

공시일	2019-11-13
기준일	2019-11-12

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

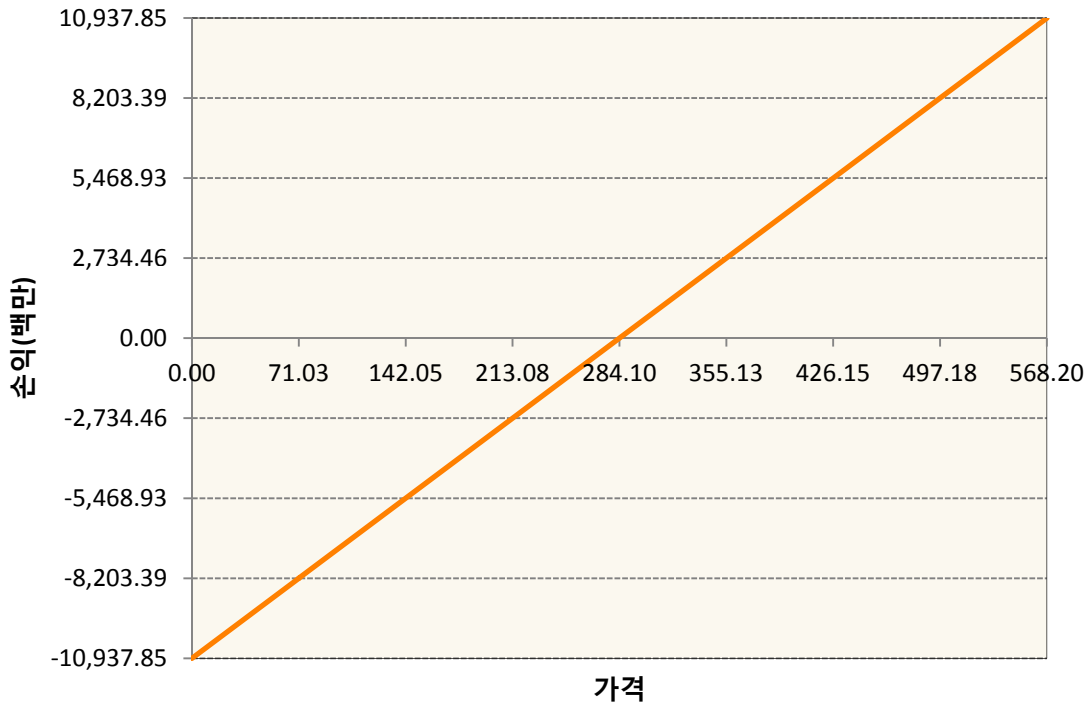
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

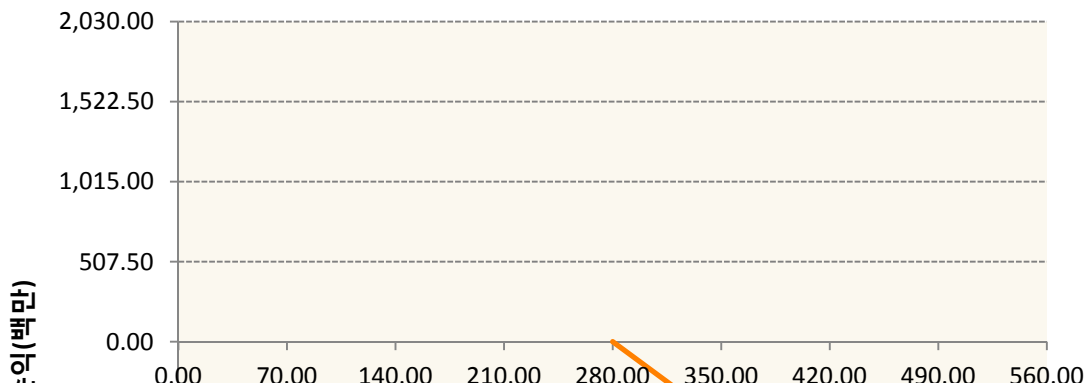
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	10,938	0	10,938	장내
누계	유가증권	옵션	3,359	20,181	-16,821	장내

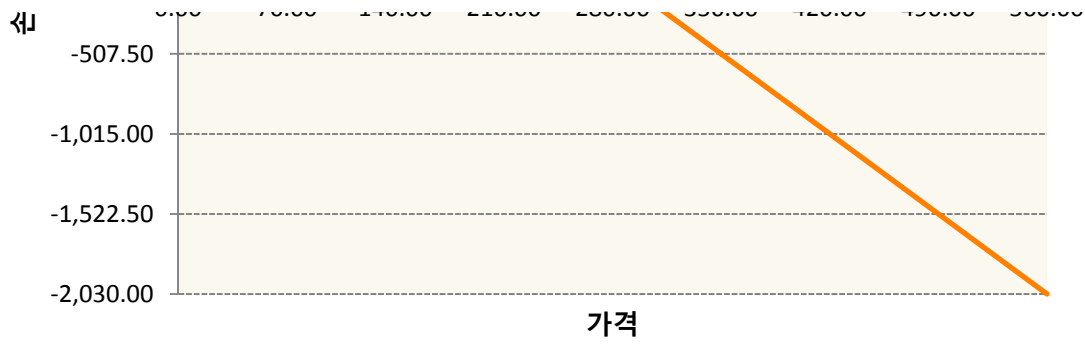
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

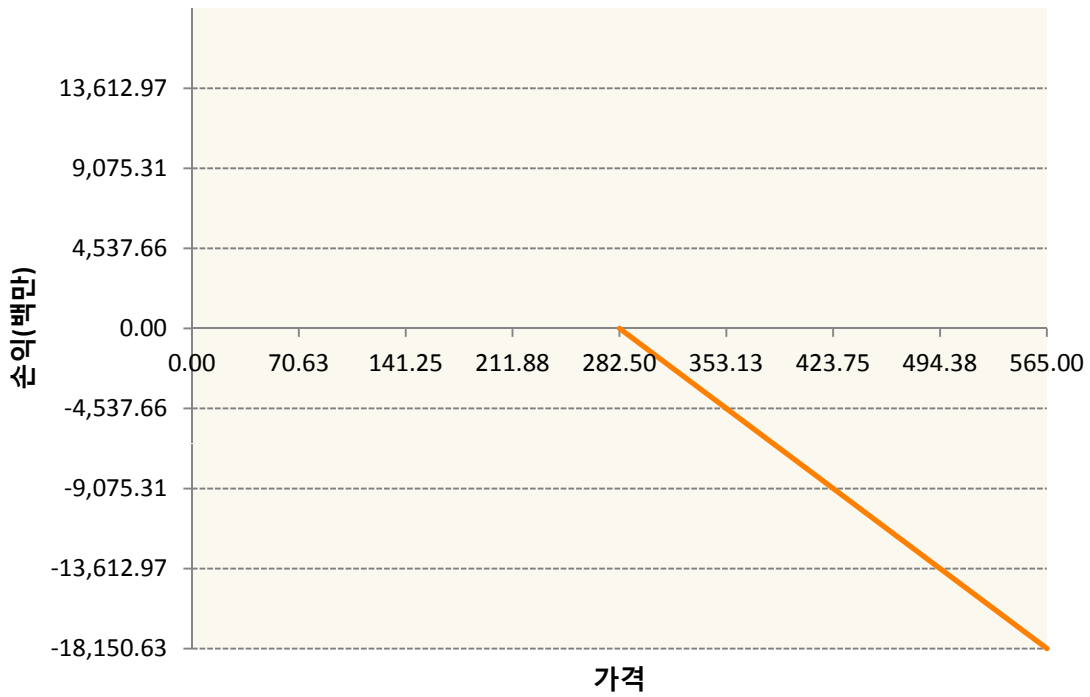


KR4201PB2800-2019-11 콜280

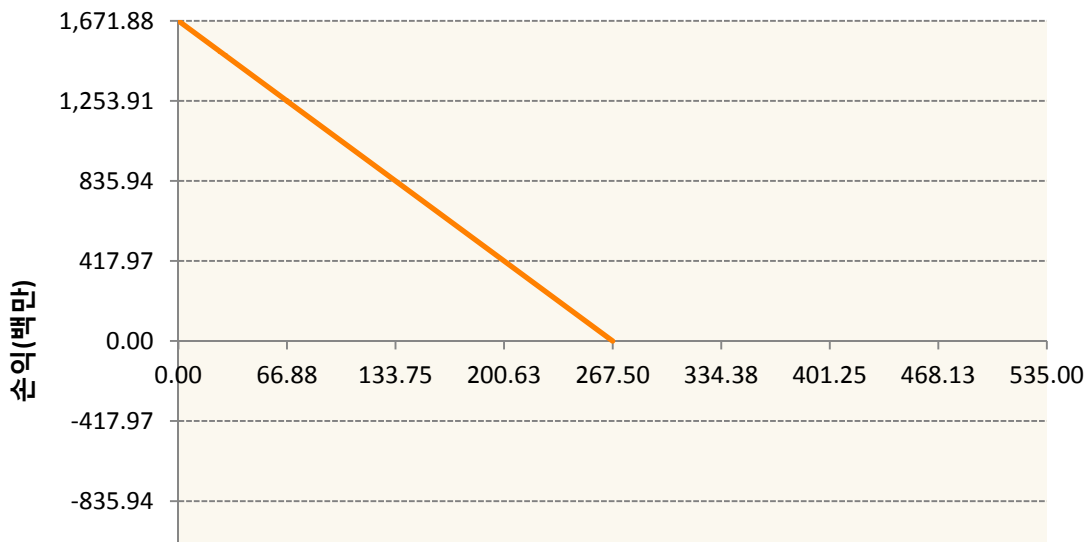


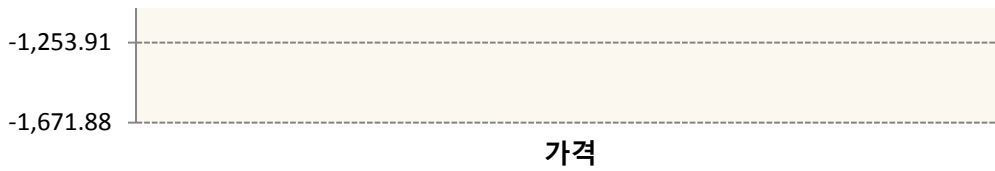


KR4201PB2826-2019-11 콜282.5

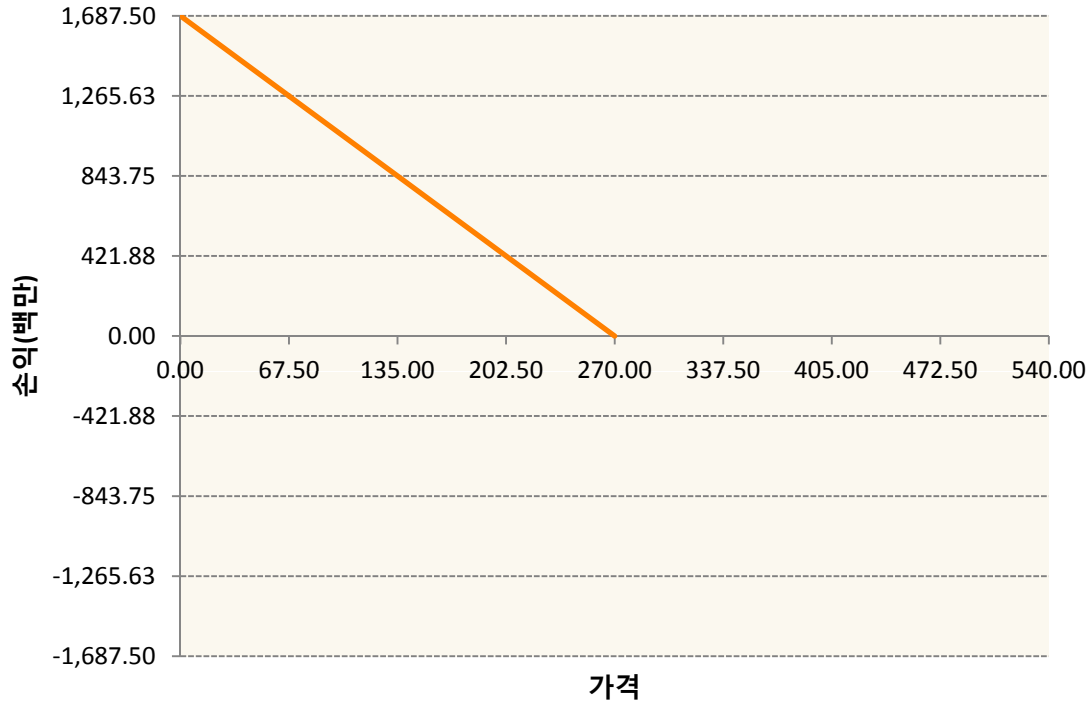


KR4301PB2676-2019-11 풋267.5





KR4301PB2700-2019-11 풋270



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101PC0002		2019-12 코스피200지수선물						874
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-874	-874	-874	-874	-874	-874	-874	
-5.33%	-582	-582	-582	-582	-582	-582	-582	
-2.67%	-291	-291	-291	-291	-291	-291	-291	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	291	291	291	291	291	291	291	
5.33%	582	582	582	582	582	582	582	
8.00%	874	874	874	874	874	874	874	
KR4201PB2800		2019-11 콜280						158
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	33	33	33	33	33	33	33	
-5.33%	33	33	33	33	33	32	32	
-2.67%	30	29	28	27	26	25	24	

0%	3	2	1	0	-1	-2	-4
2.67%	-48	-48	-48	-49	-49	-49	-50
5.33%	-103	-103	-103	-103	-103	-103	-103
8.00%	-158	-158	-158	-158	-158	-158	-158
KR4201PB2826                      2019-11 콜282.5							1,344
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	187	187	187	187	187	187	187
-5.33%	187	187	187	186	186	185	183
-2.67%	179	175	169	163	157	149	142
0%	36	24	12	0	-12	-24	-36
2.67%	-374	-377	-379	-383	-388	-393	-399
5.33%	-858	-858	-858	-858	-859	-859	-860
8.00%	-1,344	-1,344	-1,344	-1,344	-1,344	-1,344	-1,344
KR4301PB2676                      2019-11 풋267.5							41
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	41	41	41	41	41	41	41
-5.33%	2	3	3	4	4	5	5
-2.67%	0	0	0	0	0	0	0
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	0	0	0	0	0	0	0
5.33%	0	0	0	0	0	0	0
8.00%	0	0	0	0	0	0	0
KR4301PB2700                      2019-11 풋270							57
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	57	57	57	57	57	57	57
-5.33%	11	11	12	12	13	13	14
-2.67%	0	0	0	0	0	0	0
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	0	0	0	0	0	0	0
5.33%	0	0	0	0	0	0	0
8.00%	0	0	0	0	0	0	0

**4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)**

(단위:백만원)

**2,665**

공시일	2019-11-13
기준일	2019-11-12

## H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	0	0	
누계	유가증권	수익증권	192,986	0	192,986	

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

\* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

### 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

\* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

공시일	2019-11-13
기준일	2019-11-12

## H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	0	0	
누계	유가증권	수익증권	210,612	0	210,612	

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

\* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

### 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

\* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

공시일	2019-11-13
기준일	2019-11-12

## H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	0	0	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	539,628	0	539,628	
누계	통화	선도	0	528,280	-528,280	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
IE00BHNZKL13	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
FX21019U04 KRW/USD 25-11-19E		1,857
FX21019U04 KRW/USD 25-11-19E		1,950
FX21019V00 KRW/USD 10-12-19E		650
FX21019V00 KRW/USD 10-12-19E		687
FX21019V01 KRW/USD 16-12-19E		1,672
FX21019V01 KRW/USD 18-11-19E		2,452
FX21019V01 KRW/USD 18-11-19E		464
FX21019V02 KRW/USD 21-11-19E		5,052
FX21019V02 KRW/USD 23-12-19E		4,736
FX21019V02 KRW/USD 23-01-20E		1,393
FX21019V02 KRW/USD 25-11-19E		2,786
FX21019V02 KRW/USD 23-01-20E		1,495
FX21019V02 KRW/USD 25-11-19E		2,823
FX21019V03 KRW/USD 29-11-19E		929
FX21019V03 KRW/USD 29-11-19E		929
FX21019V04 KRW/USD 29-11-19E		1,857
FX21019V04 KRW/USD 29-11-19E		1,857
FX21019V04 KRW/USD 06-12-19E		929
FX21019V04 KRW/USD 06-12-19E		929
FX21019V04 KRW/USD 06-12-19E		929
FX21019V04 KRW/USD 06-12-19E		929
FX21019V04 KRW/USD 06-12-19E		464
FX21019X00 KRW/USD 06-12-19E		650
FX21019X00 KRW/USD 10-12-19E		464
FX21019X00 KRW/USD 10-12-19E		464
FX21019X00 KRW/USD 10-12-19E		464

FX21019X00 KRW/USD 12-12-19E

1,523

FX21019X00 KRW/USD 12-12-19E

929

**4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)**

(단위:백만원)

**13,361**

공시일	2019-11-13
기준일	2019-11-12

## 스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

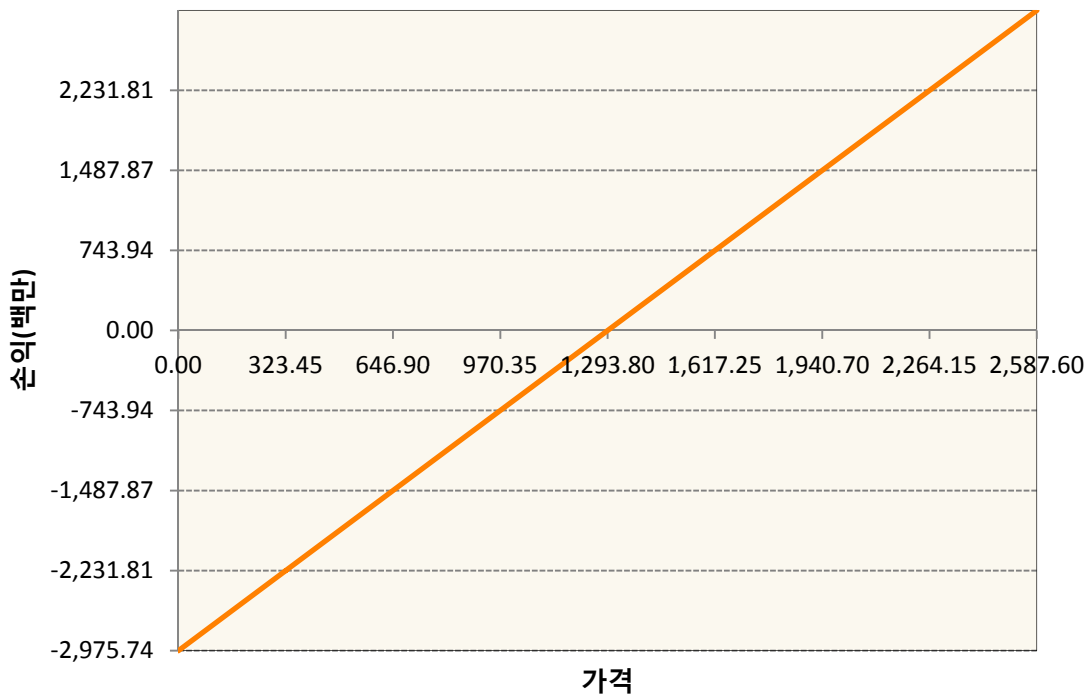
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

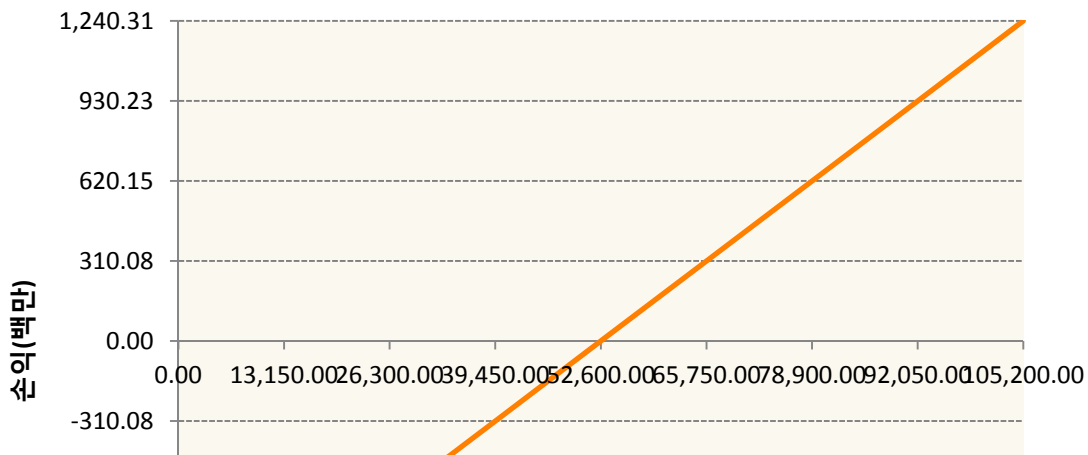
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	524	-524	장내
누계	유가증권	선물	4,216	0	4,216	장내

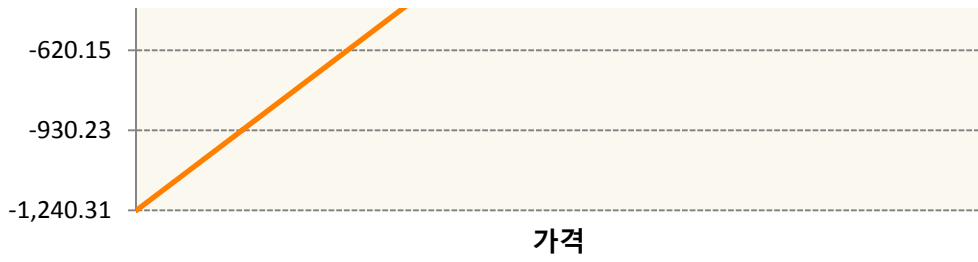
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4108PC0005-2019-12 KRX300 선물



KR4111PB0001-2019-11 삼성전자개별선물





**3. 시나리오 별 손익구조변동(최대손실예상금액)** (단위:백만원)

KR4108PC0005		2019-12 KRX300 선물						238
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-238	-238	-238	-238	-238	-238	-238	
-5.33%	-159	-159	-159	-159	-159	-159	-159	
-2.67%	-79	-79	-79	-79	-79	-79	-79	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	79	79	79	79	79	79	79	
5.33%	159	159	159	159	159	159	159	
8.00%	238	238	238	238	238	238	238	
KR4111PB0001		2019-11 삼성전자개별선물						99
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-99	-99	-99	-99	-99	-99	-99	
-5.33%	-66	-66	-66	-66	-66	-66	-66	
-2.67%	-33	-33	-33	-33	-33	-33	-33	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	33	33	33	33	33	33	33	
5.33%	66	66	66	66	66	66	66	
8.00%	99	99	99	99	99	99	99	

**4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)** (단위:백만원)

**293**

공시일	2019-11-13
기준일	2019-11-12

## 커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

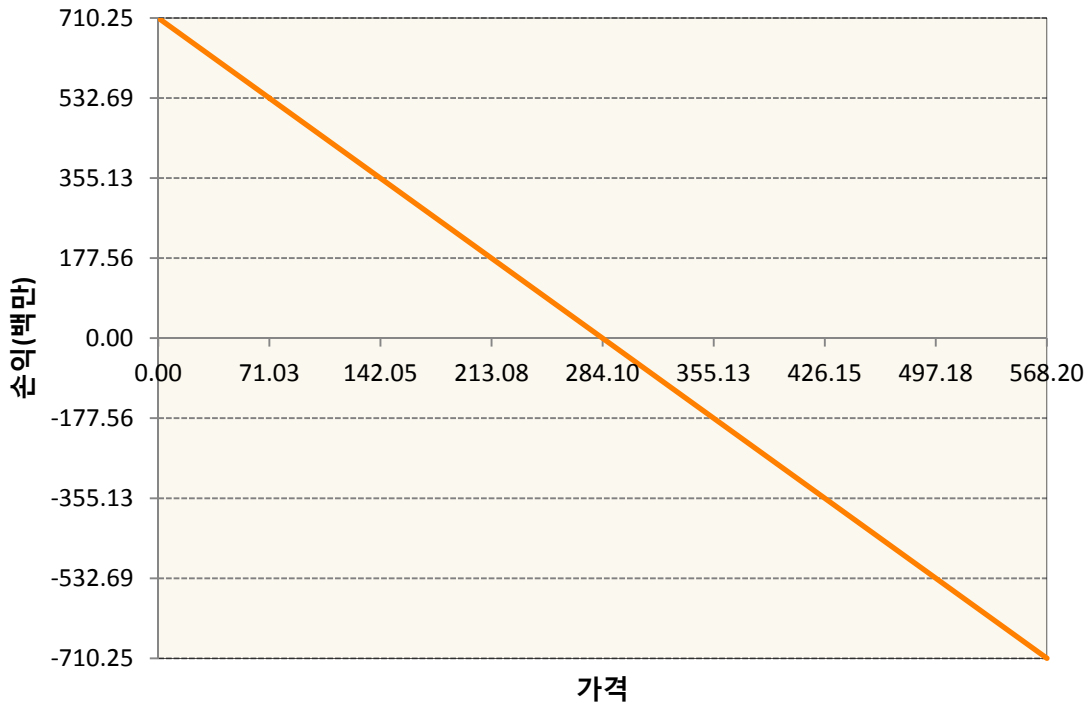
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

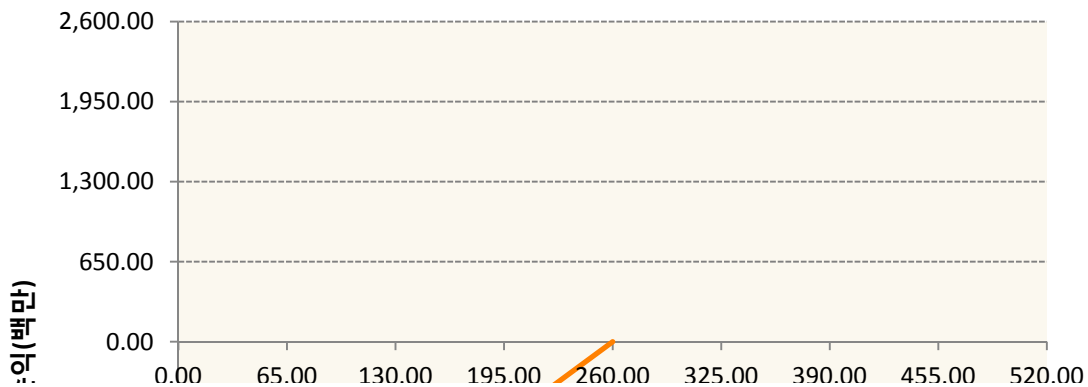
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	710	-710	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,650	-3,650	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

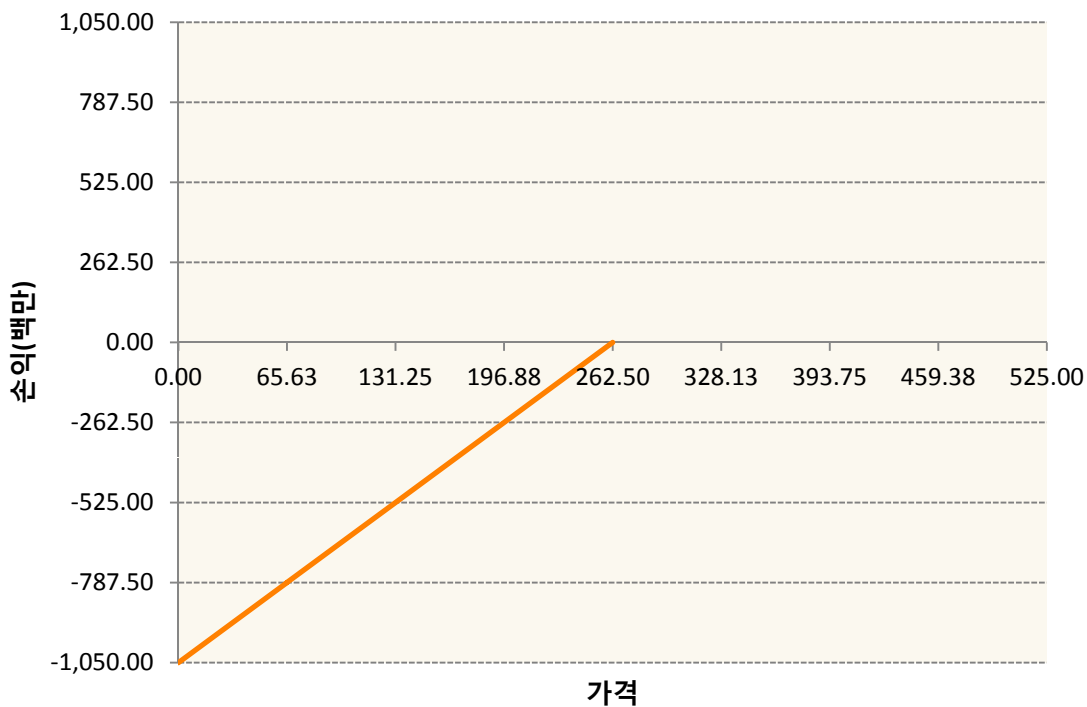


KR4301PB2601-2019-11 풋260





KR4301PB2627-2019-11 풋262.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101PC0002		2019-12 코스피200지수선물						57
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	57	57	57	57	57	57	57	
-5.33%	38	38	38	38	38	38	38	
-2.67%	19	19	19	19	19	19	19	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	-19	-19	-19	-19	-19	-19	-19	
5.33%	-38	-38	-38	-38	-38	-38	-38	
8.00%	-57	-57	-57	-57	-57	-57	-57	
KR4301PB2601		2019-11 풋260						9
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-4	-5	-5	-6	-7	-8	-9
-5.33%	0	0	0	0	0	0	0
-2.67%	0	0	0	0	0	0	0
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	0	0	0	0	0	0	0
5.33%	0	0	0	0	0	0	0
8.00%	0	0	0	0	0	0	0

KR4301PB2627

2019-11 풋262.5

9

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-7	-7	-8	-8	-8	-9	-9
-5.33%	0	0	0	0	0	0	0
-2.67%	0	0	0	0	0	0	0
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	0	0	0	0	0	0	0
5.33%	0	0	0	0	0	0	0
8.00%	0	0	0	0	0	0	0

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

44

공시일	2019-11-13
기준일	2019-11-12

## H2O트리오(H)(채권혼합-파생재간접형)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	0	0	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	15,635	0	15,635	
누계	통화	선도	638	18,817	-18,178	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
FX21019V01 KRW/USD 10-12-19E		368
FX21019V02 KRW/USD 25-11-19E		316
FX21019V02 KRW/USD 13-11-19E		279
FX21019V03 KRW/USD 29-11-19E		316
FX21019V04 USD/KRW 13-11-19E		19
FX21019X00 USD/KRW 13-11-19E		33
FX21019X01 KRW/USD 13-01-20E		228

### 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

<b>492</b>
------------

공시일	2019-11-13
기준일	2019-11-12

## 스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	스왑	680	0	680	장외
누계	통화	선도	199	404	-205	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2.55E+11 E1VFN30 VN ETF(EUR)	36
2.55E+11 E1VFN30 VN ETF(EUR)	18
FX21019U00 KRW/EUR 22-11-19E	2
FX21019U02 KRW/EUR 22-11-19E	2
FX21019U04 EUR/KRW 22-11-19E	2
FX21019V00 KRW/EUR 22-11-19E	2
FX21019V00 KRW/EUR 22-11-19E	2
FX21019V01 KRW/EUR 22-11-19E	2
FX21019V01 KRW/EUR 22-11-19E	2
FX21019V02 KRW/EUR 22-11-19E	4
FX21019V03 EUR/KRW 22-11-19E	14
FX21019V04 KRW/EUR 31-01-20E	3
FX21019X00 KRW/EUR 31-01-20E	3
FX21019X00 KRW/EUR 31-01-20E	6
FX21019X01 KRW/EUR 31-01-20E	5

### 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

62
----

공시일	2019-11-13
기준일	2019-11-12

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

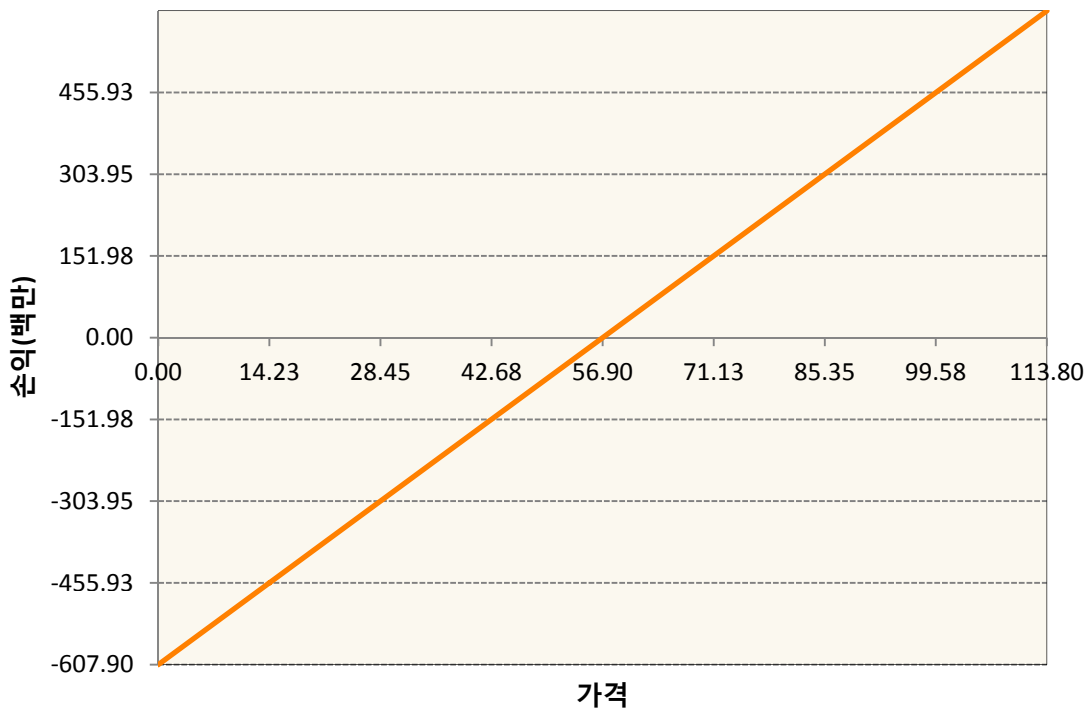
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

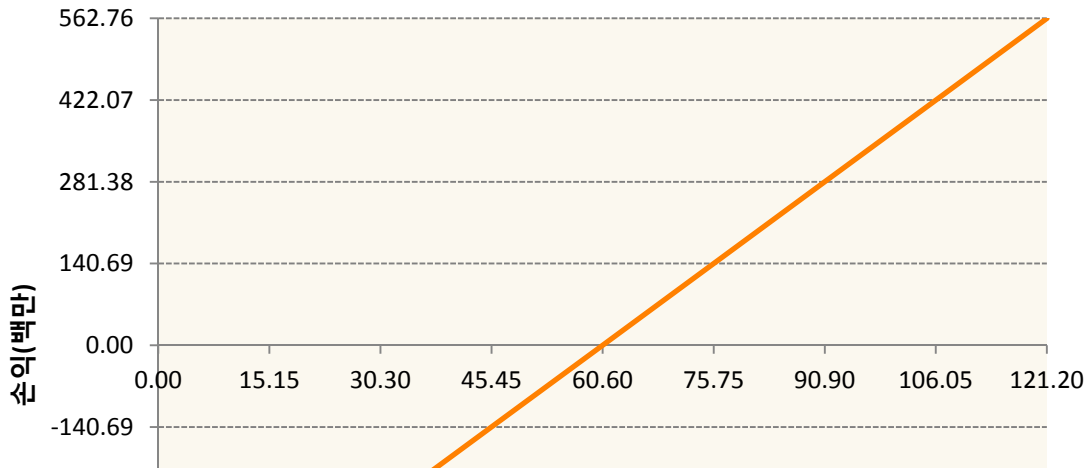
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,487	290	2,197	

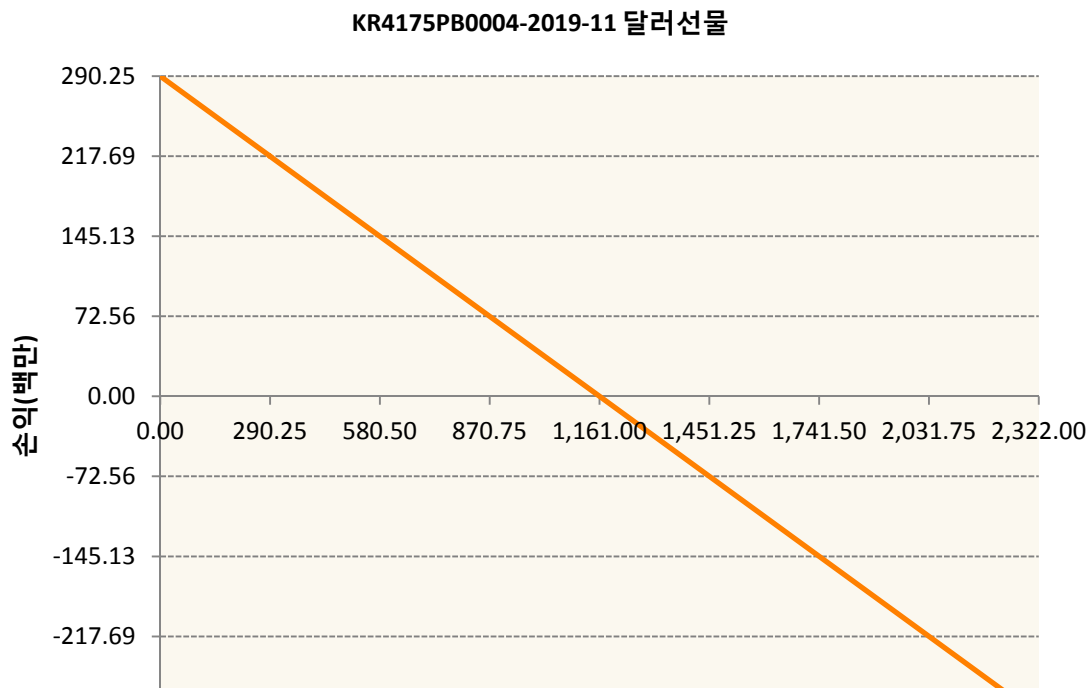
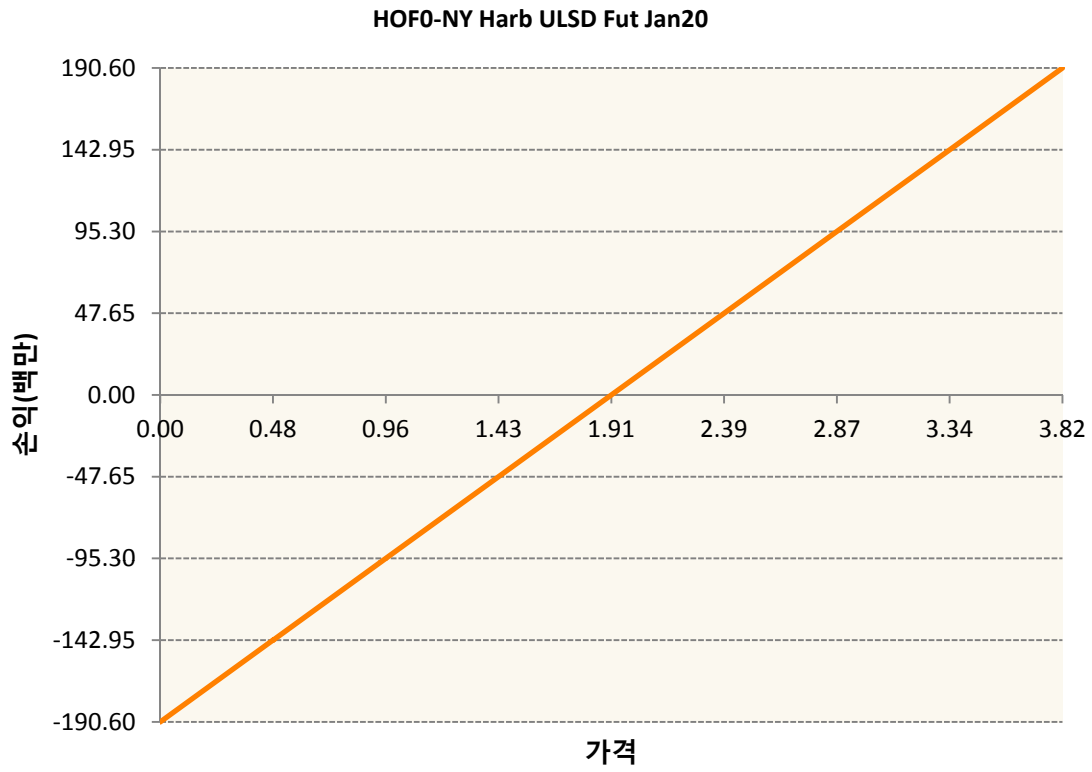
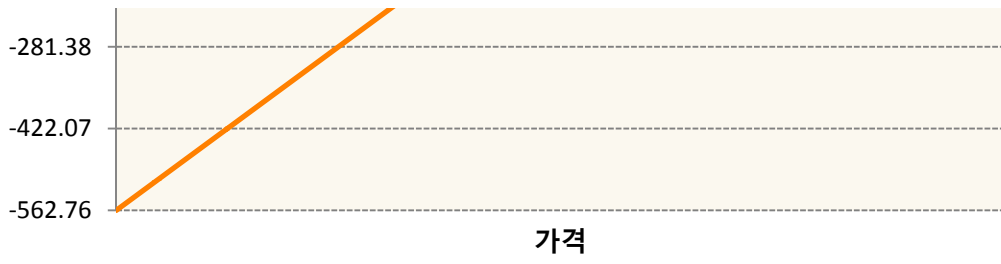
### 2. 만기시점의 손익구조

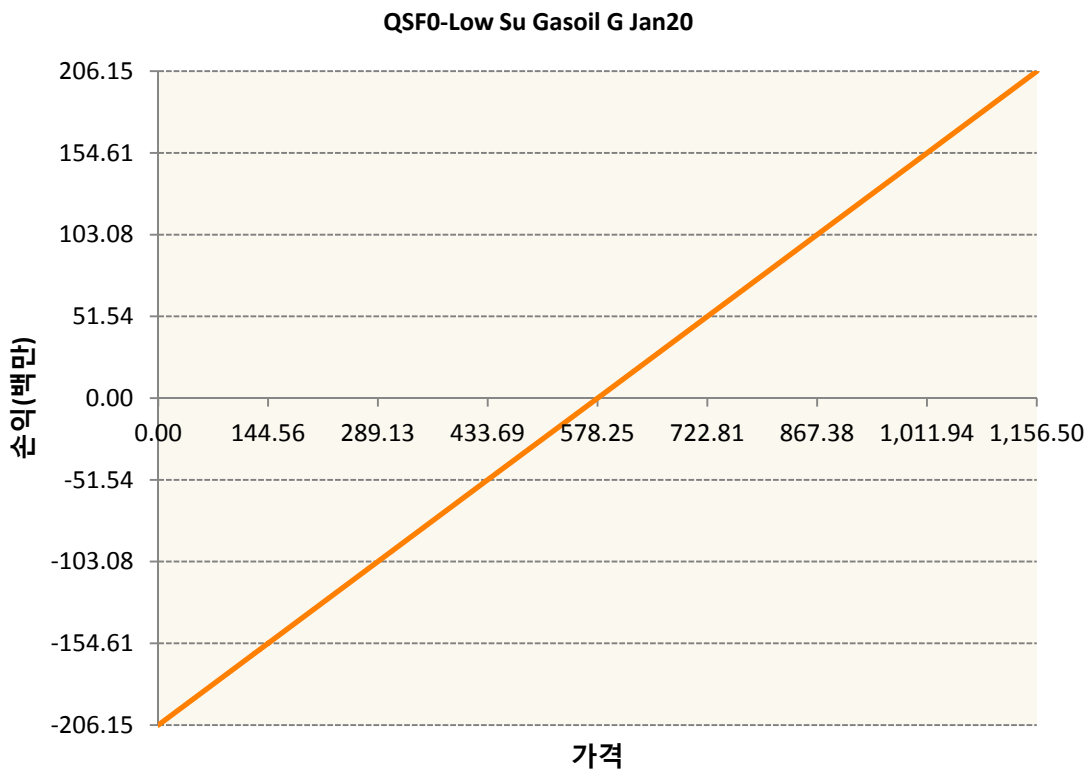
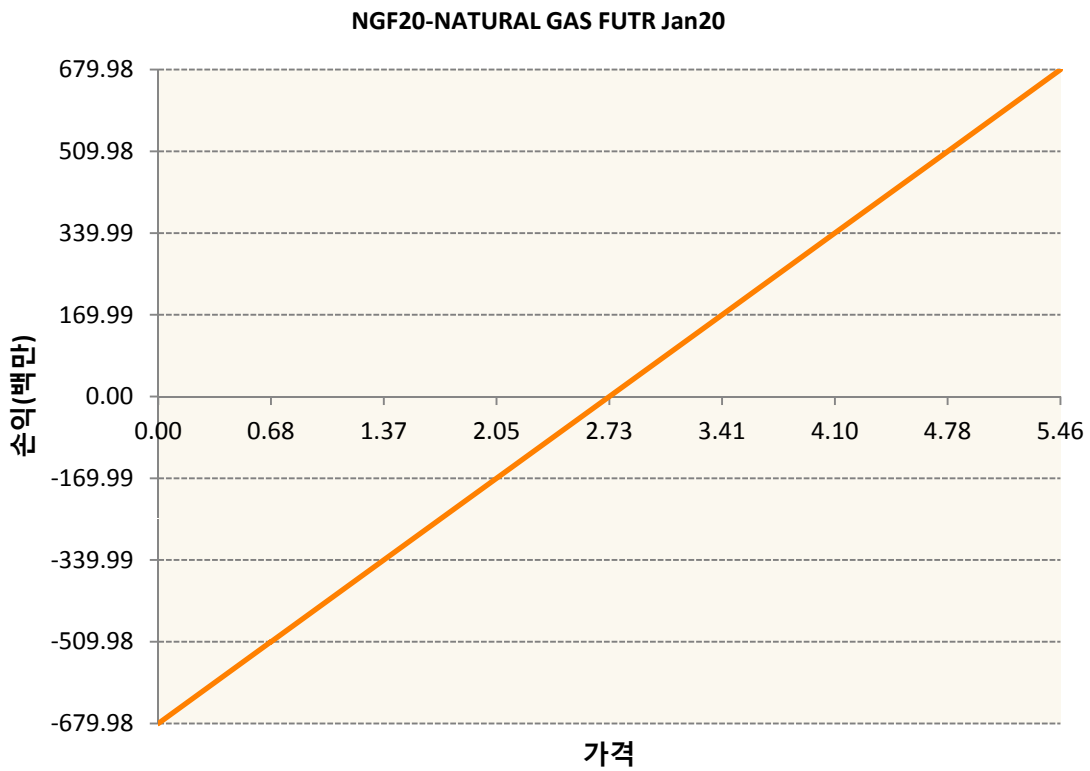
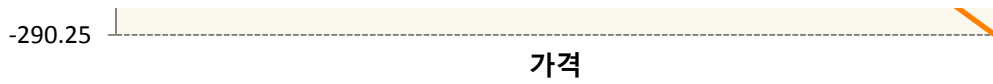
CLF0-WTI CRUDE FUTURE Jan20



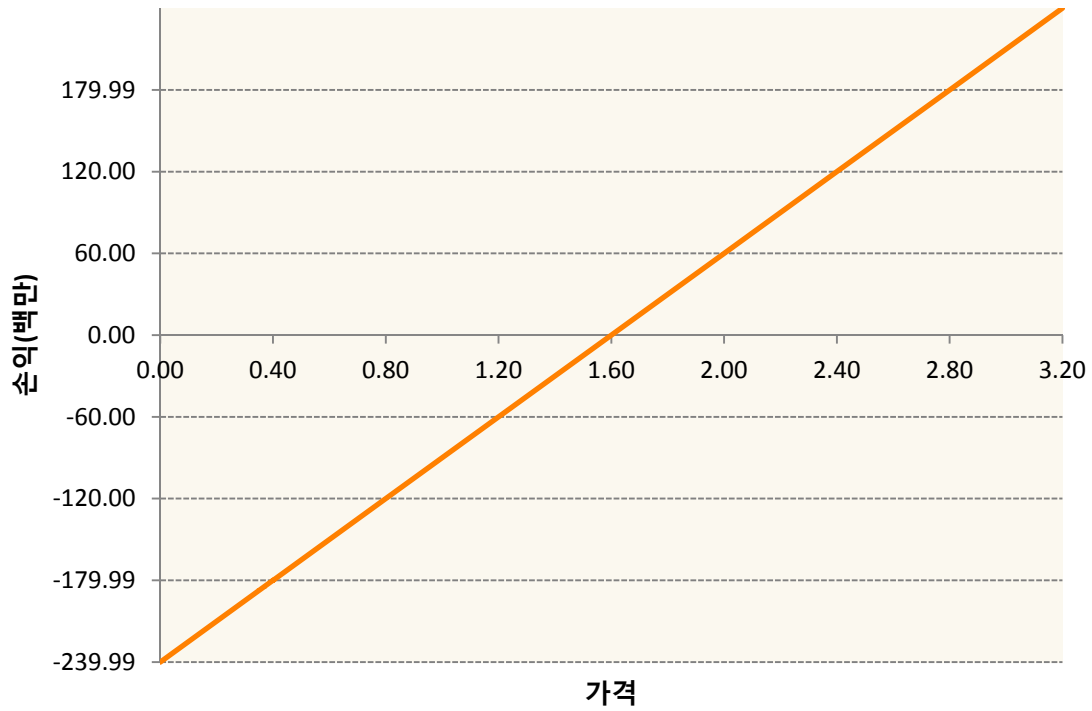
COH0-BRENT CRUDE FUTR Mar20







XBF0-GASOLINE RBOB FUT Jan20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLF0	WTI CRUDE FUTURE Jan20	49
COH0	BRENT CRUDE FUTR Mar20	45
HOF0	NY Harb ULSD Fut Jan20	15
KR4175PB00	2019-11 달러선물	23
NGF20	NATURAL GAS FUTR Jan20	54
QSF0	Low Su Gasoil G Jan20	16
XBF0	GASOLINE RBOB FUT Jan20	19

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

417

공시일	2019-11-13
기준일	2019-11-12

## 애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

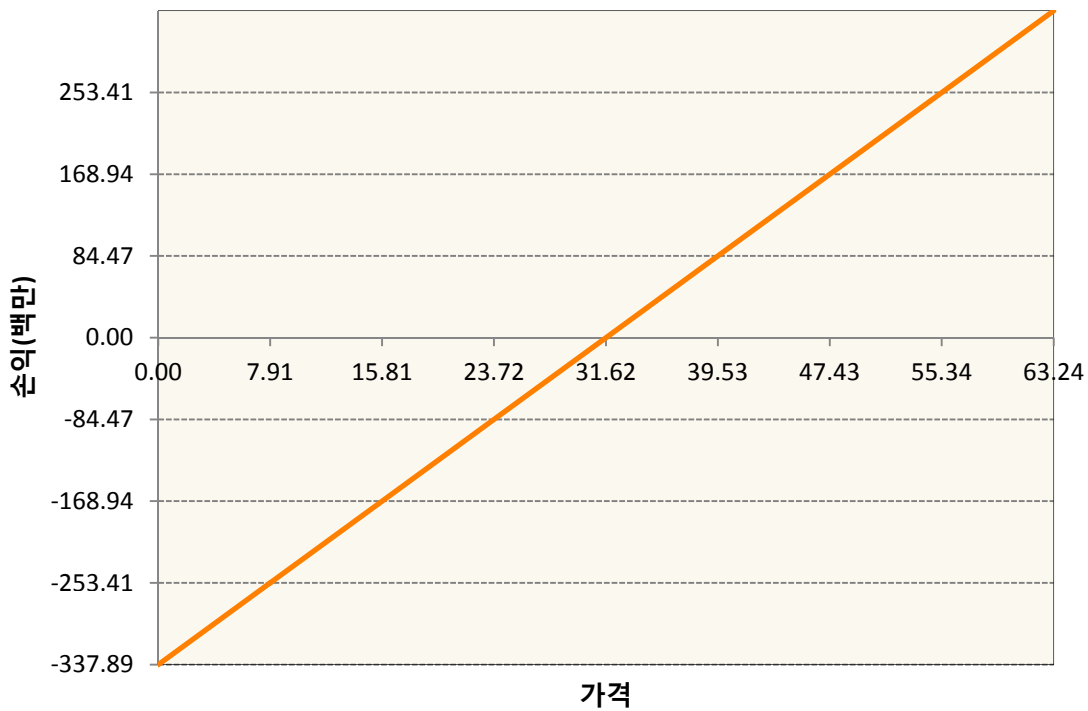
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

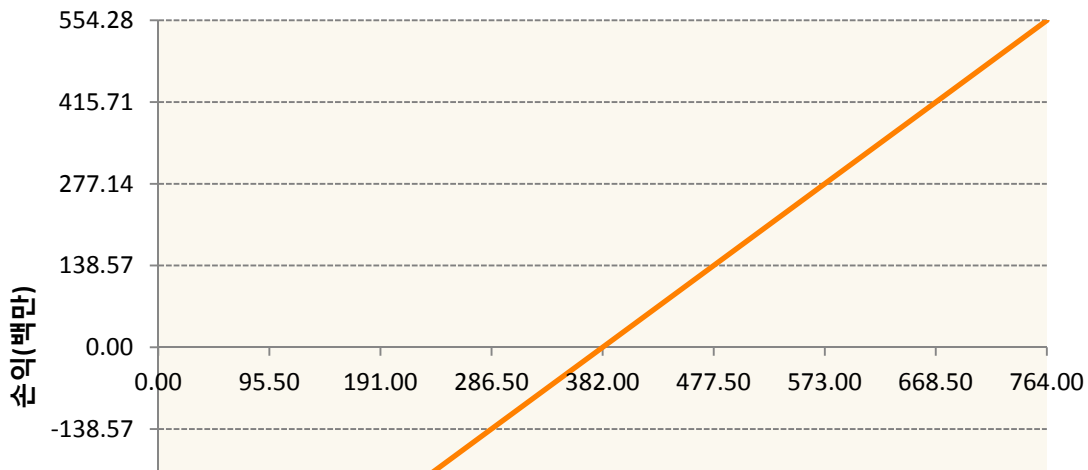
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,813	93	2,720	

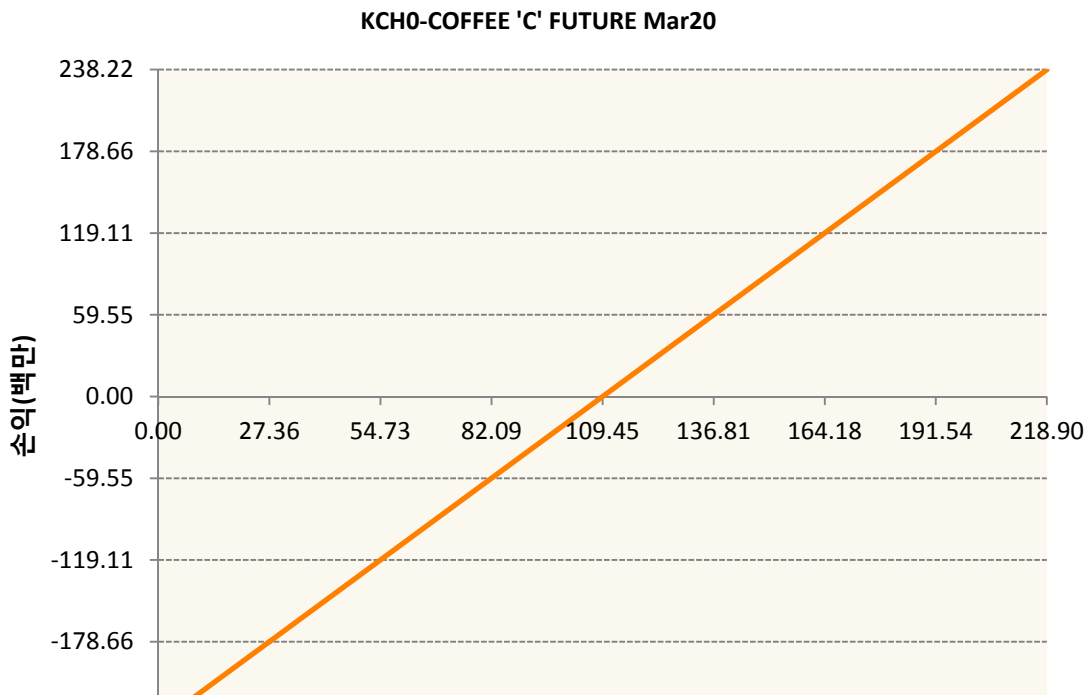
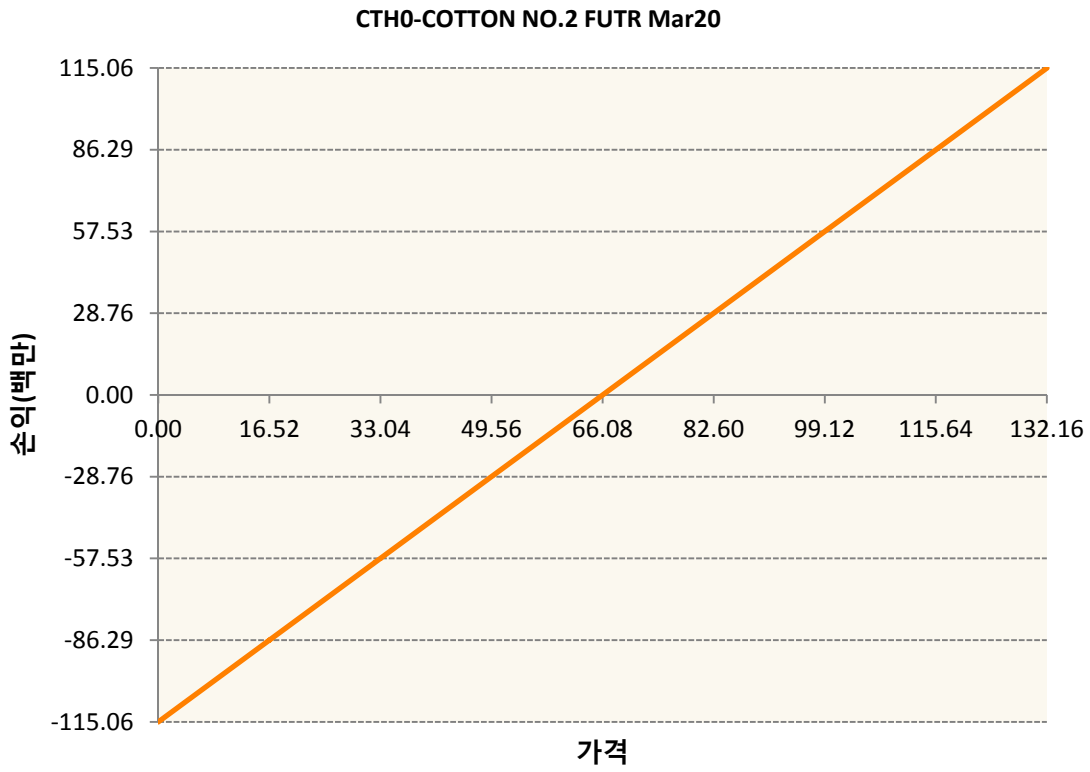
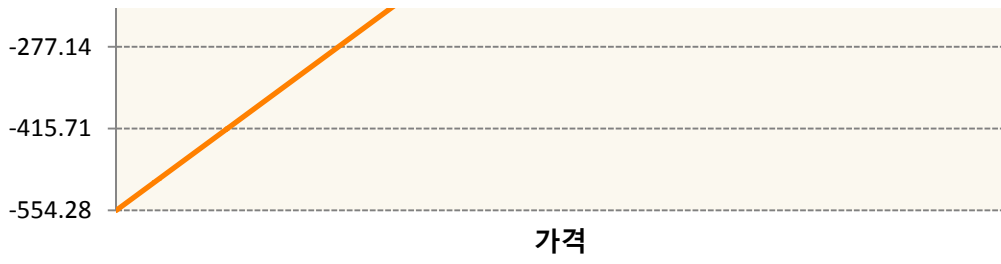
### 2. 만기시점의 손익구조

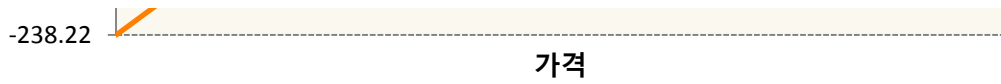
**BOF0-SOYBEAN OIL FUTR Jan20**



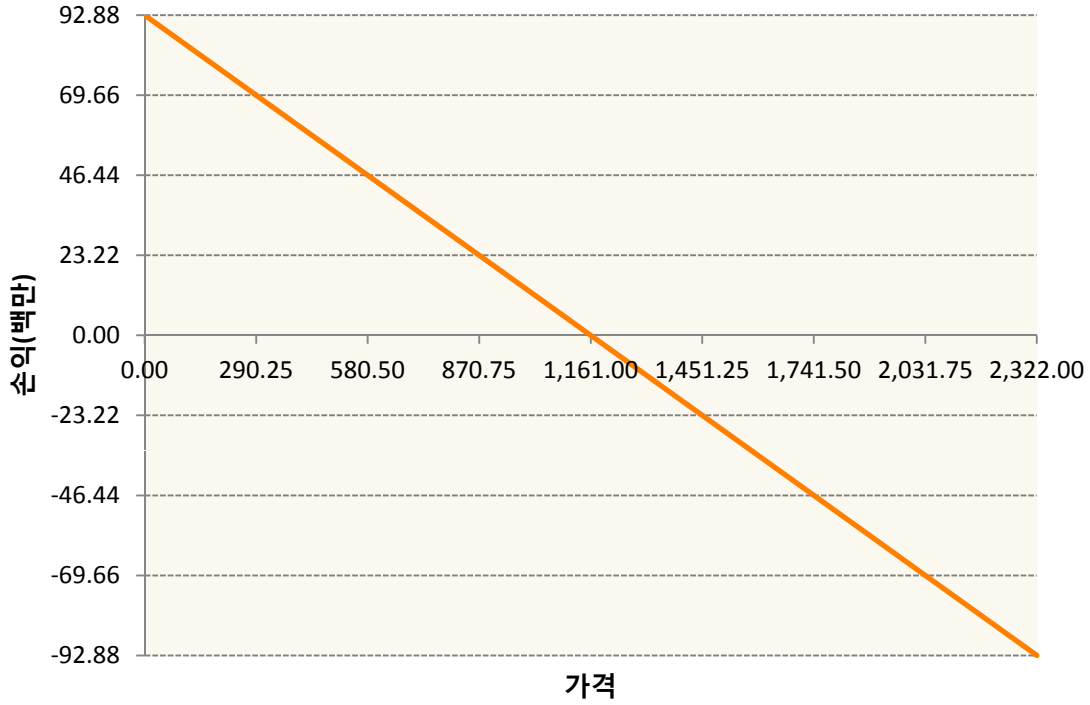
**CH0-CORN FUTURE Mar20**



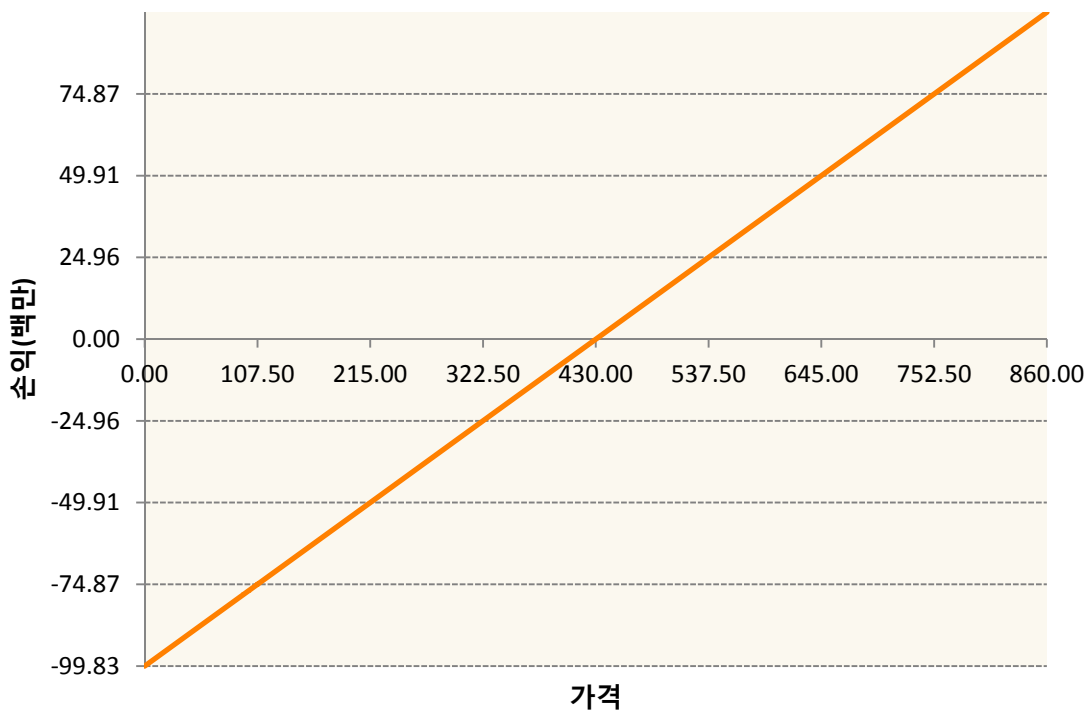




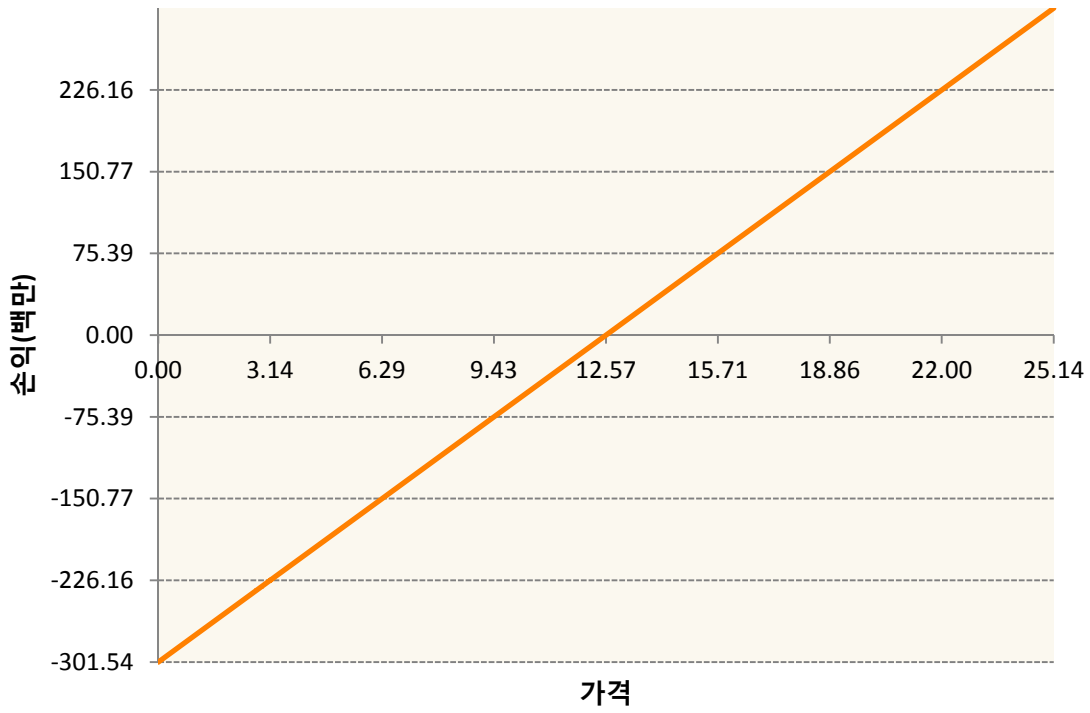
KR4175PB0004-2019-11 달러선물



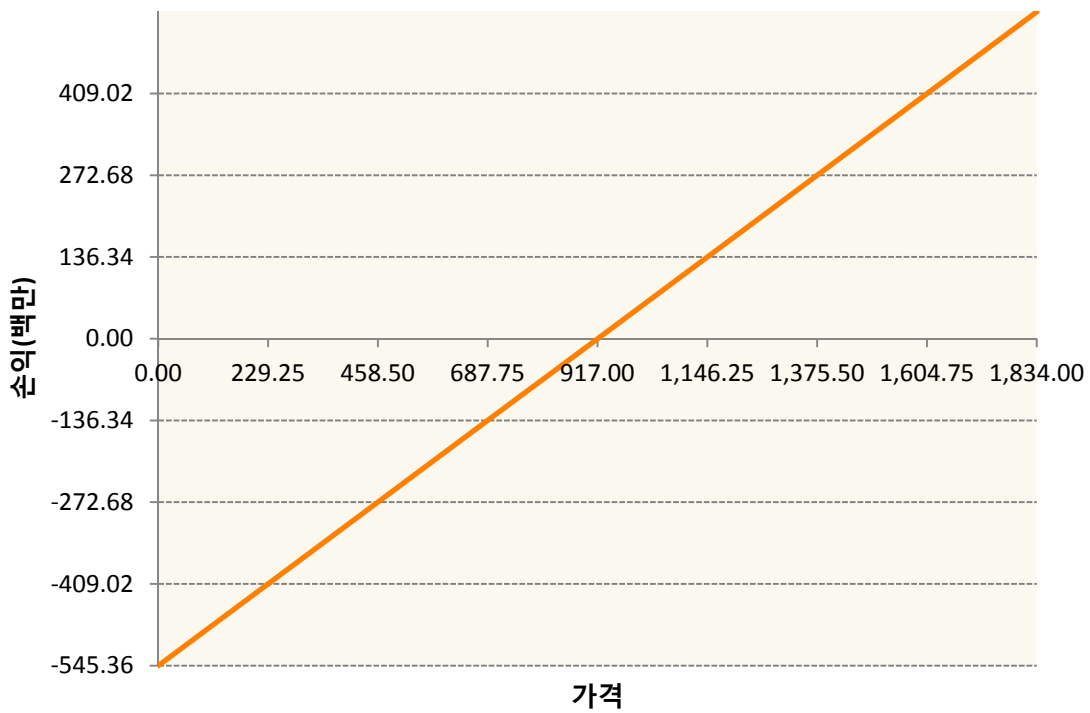
KWH0-KC HRW WHEAT FUT Mar20



SBH0-Sugar Mar20

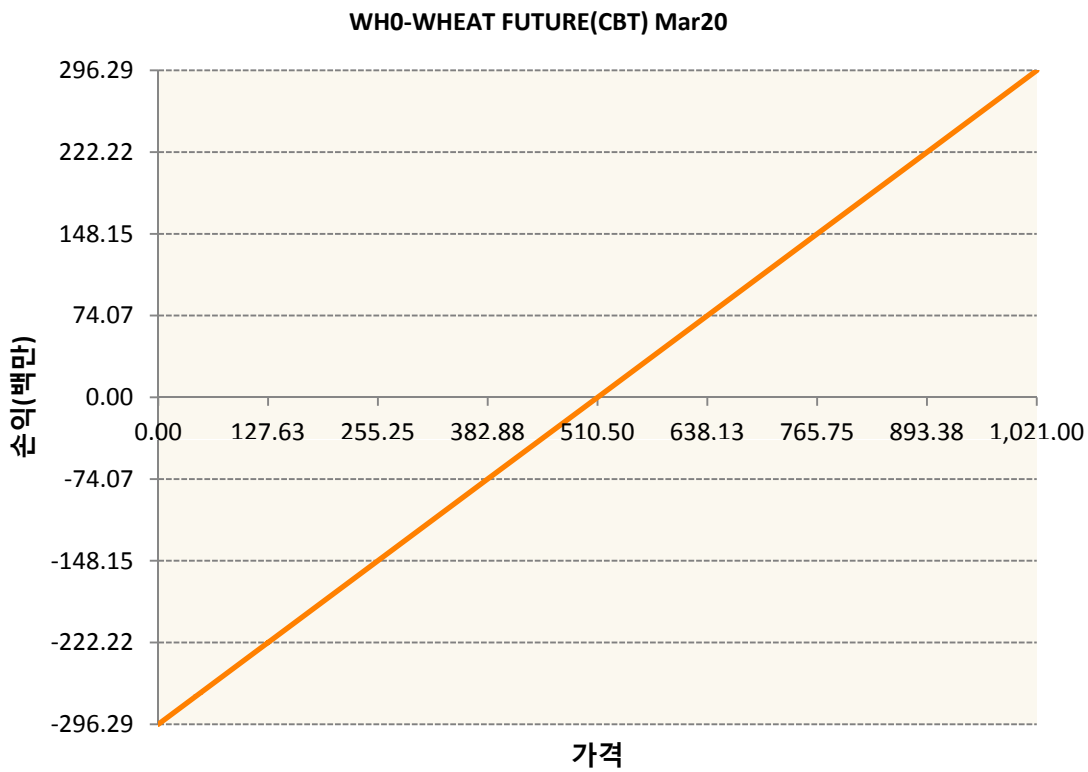
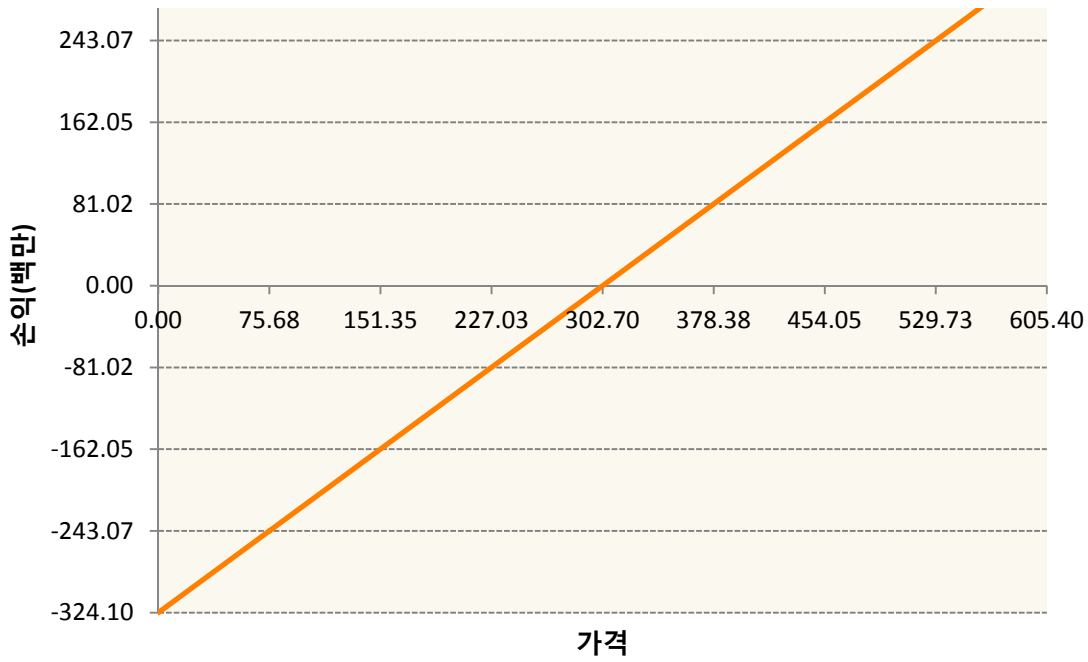


SF0-SOYBEAN FUTURE Jan20



SMF0-SOYBEAN MEAL FUTR Jan20





**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)**

(단위:백만원)

BOF0	SOYBEAN OIL FUTR Jan20	27
CH0	CORN FUTURE Mar20	44
CTH0	COTTON NO.2 FUTR Mar20	9
KCH0	COFFEE 'C' FUTURE Mar20	19
KR4175PB00	2019-11 달러선물	7

KWH0	KC HRW WHEAT FUT Mar20	8
SBH0	Sugar Mar20	24
SF0	SOYBEAN FUTURE Jan20	44
SMF0	SOYBEAN MEAL FUTR Jan20	26
WH0	WHEAT FUTURE(CBT) Mar20	24

**4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)**

(단위:백만원)

**248**